

공시일	2019-06-05
기준일	2019-06-04

## 포커스농산물모(채권-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	6	0	6	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

### 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음



4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

91

공시일	2019-06-05
기준일	2019-06-04

## SMART합성-MSCI선진국증권상장

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	14,160	0	14,160	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0( 신한MXWO 미래S190522

1,095

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

### 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

657

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-06-05
기준일	2019-06-04

## SMART중국본토중소형CSI500상장

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	7,434	0	7,434	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S180910 신규)	290
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S190129 신규)	80
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(신규)	136

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

### 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

<b>851</b>
------------

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2019-06-05
기준일	2019-06-04

## 유로인덱스모(주식-파생형)

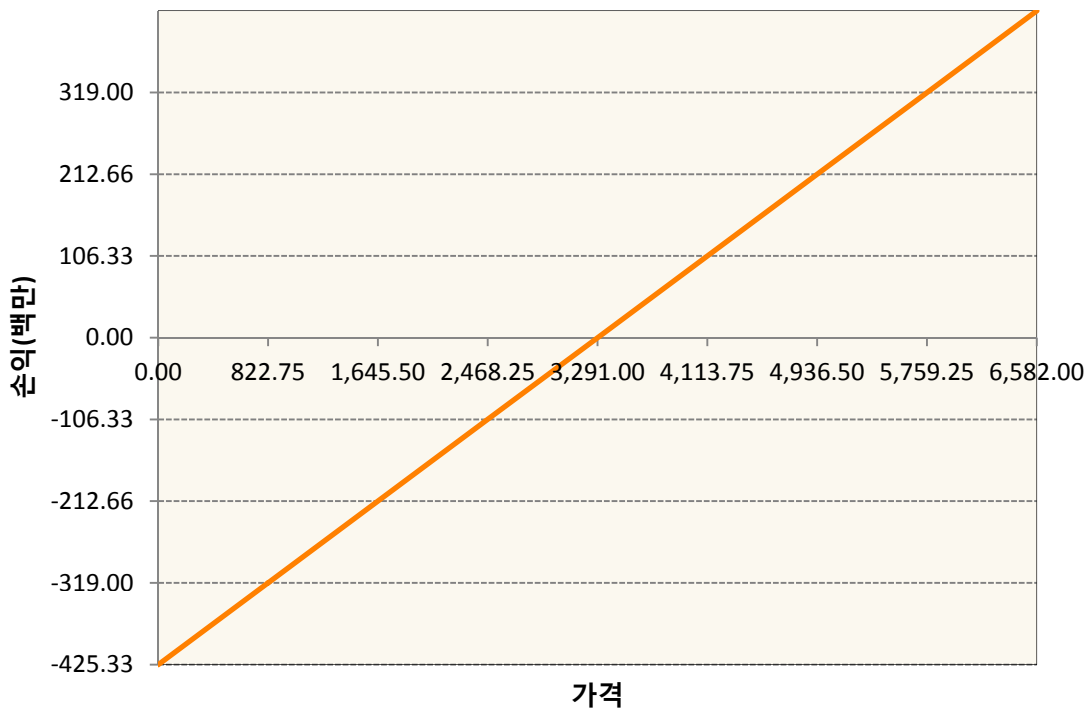
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	425	0	425	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGM9-EURO STOXX 50 JUN19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM9	EURO STOXX 50 JUN19	34
------	---------------------	----

### 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

25
----

공시일	2019-06-05
기준일	2019-06-04

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

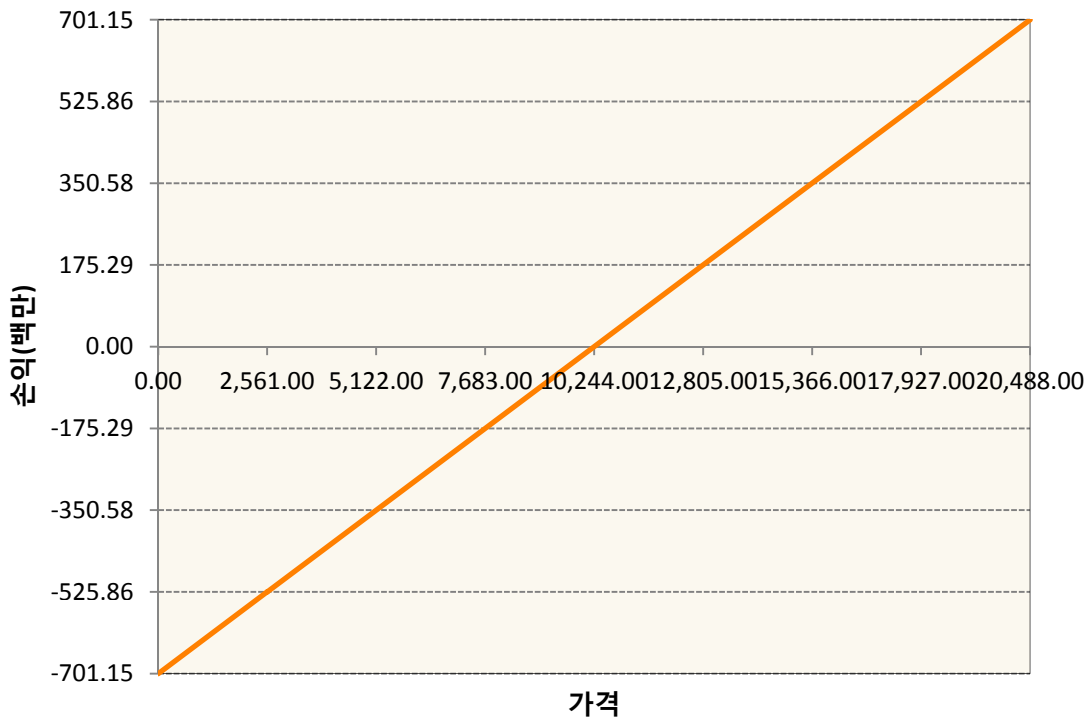
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	701	0	701	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

HCM9-HSCEI Futures Jun19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCM9	HSCEI Futures Jun19	56
------	---------------------	----

### 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

57
----

공시일	2019-06-05
기준일	2019-06-04

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

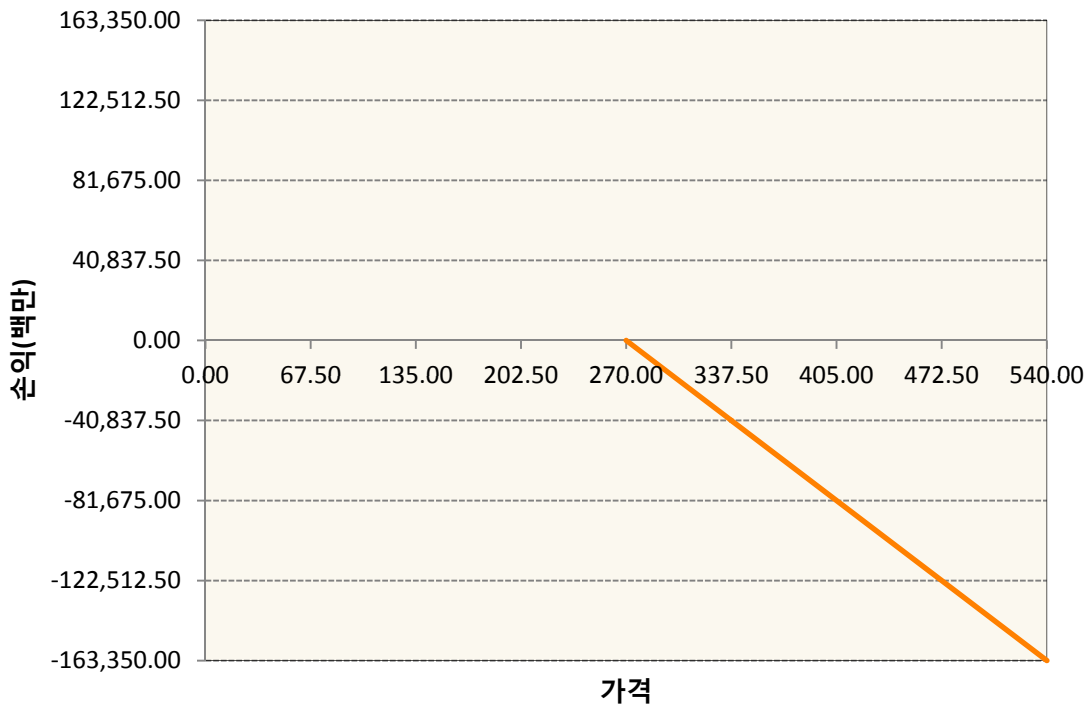
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

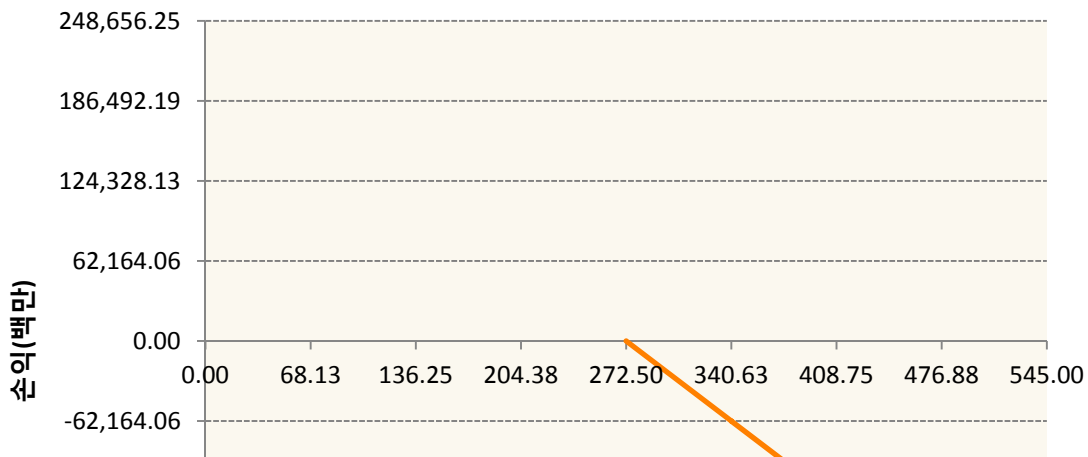
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	614,506	-614,506	장내

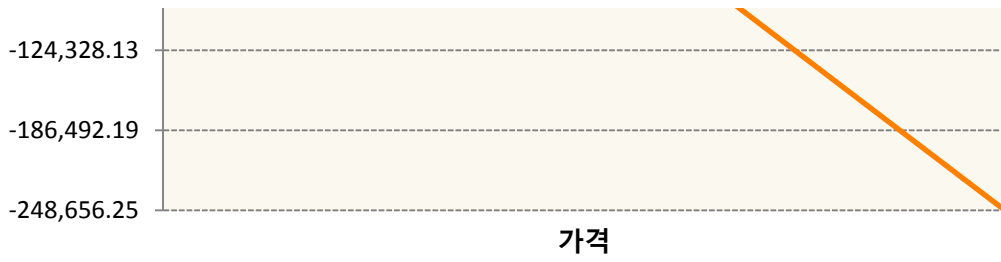
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P62701-2019-06 콜270



KR4201P62727-2019-06 콜272.5





KR4301P62709-2019-06 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201P62701		2019-06 콜270					9,883
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,968	1,965	1,957	1,945	1,925	1,898	1,862
-5.33%	1,938	1,908	1,865	1,810	1,741	1,661	1,569
-2.67%	1,685	1,570	1,440	1,299	1,148	990	824
0%	637	426	214	0	-214	-430	-645
2.67%	-1,780	-1,972	-2,169	-2,370	-2,574	-2,781	-2,990
5.33%	-5,390	-5,482	-5,590	-5,712	-5,846	-5,990	-6,144
8.00%	-9,548	-9,572	-9,609	-9,658	-9,720	-9,796	-9,883
KR4201P62727		2019-06 콜272.5					13,703
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,145	2,142	2,137	2,126	2,108	2,081	2,044

-5.33%	2,125	2,101	2,061	2,006	1,933	1,843	1,736
-2.67%	1,921	1,799	1,653	1,486	1,301	1,100	885
0%	873	590	298	0	-303	-610	-920
2.67%	-2,013	-2,339	-2,667	-2,997	-3,327	-3,658	-3,991
5.33%	-6,919	-7,115	-7,332	-7,566	-7,813	-8,072	-8,341
8.00%	-12,991	-13,055	-13,143	-13,253	-13,384	-13,535	-13,703
KR4301P62709                      2019-06 풋270							14,638
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-14,630	-14,630	-14,631	-14,631	-14,632	-14,634	-14,638
-5.33%	-9,282	-9,284	-9,289	-9,299	-9,314	-9,335	-9,363
-2.67%	-3,997	-4,043	-4,101	-4,172	-4,254	-4,346	-4,446
0%	513	345	173	0	-175	-351	-528
2.67%	2,754	2,619	2,476	2,327	2,173	2,014	1,852
5.33%	3,191	3,165	3,127	3,078	3,018	2,946	2,865
8.00%	3,219	3,217	3,214	3,207	3,196	3,179	3,156

**4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)**

(단위:백만원)

**41,687**

공시일	2019-06-05
기준일	2019-06-04

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

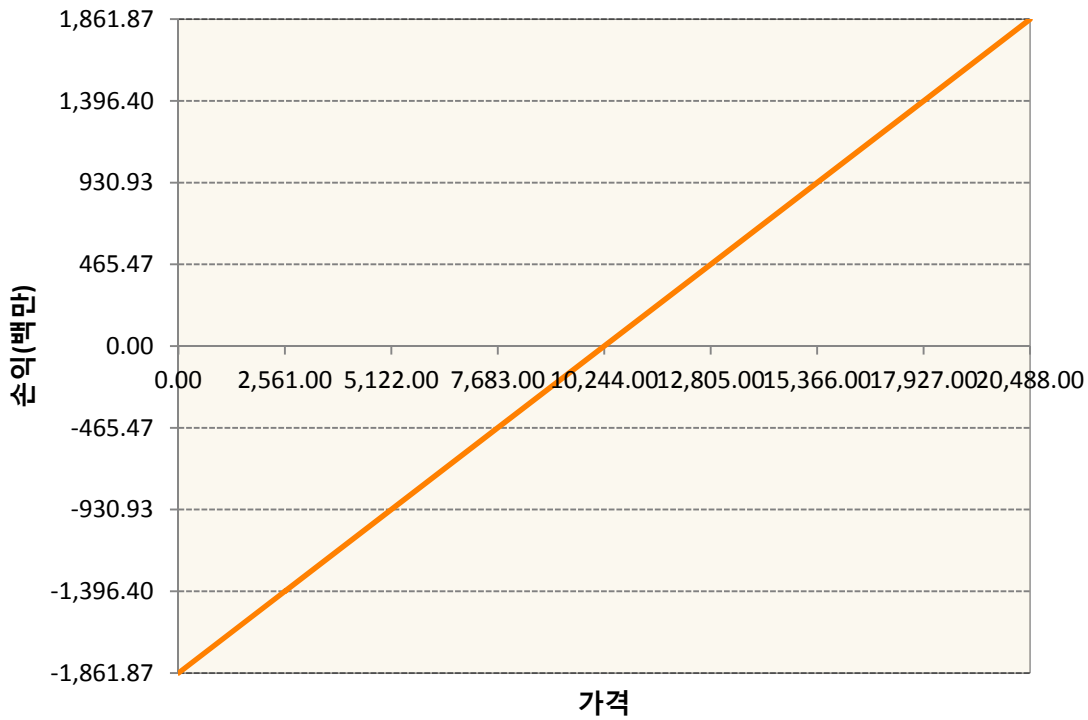
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

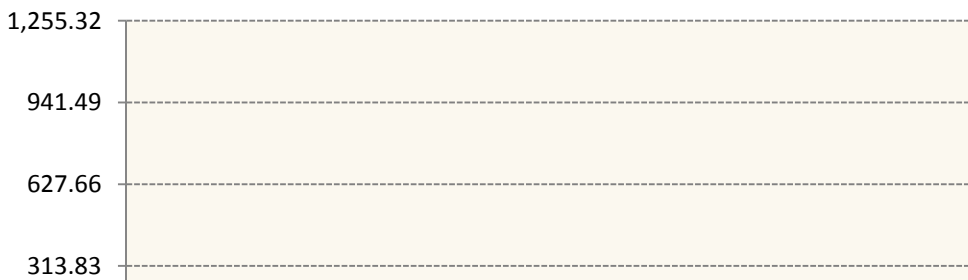
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,862	0	1,862	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,045	-5,045	장내
누계	통화	선도	151	3,168	-3,017	장외

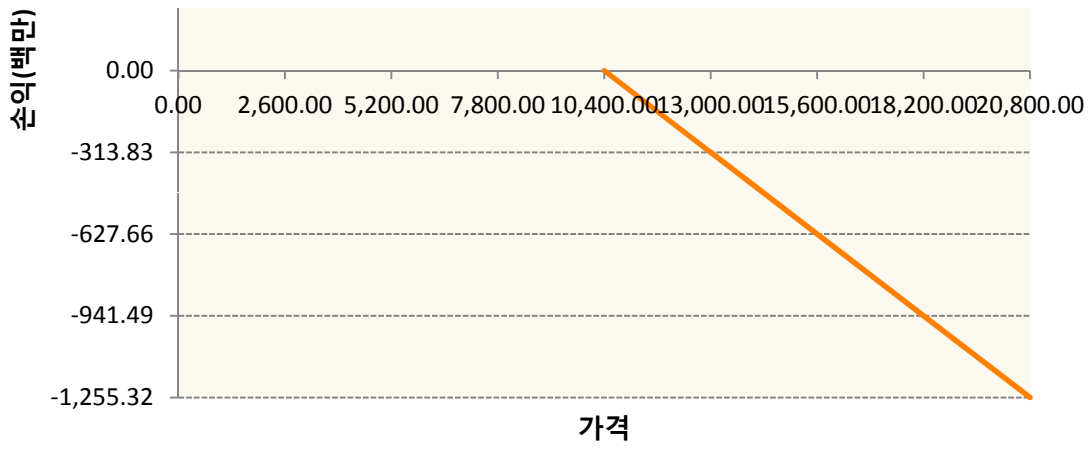
### 2. 만기시점의 손익구조

HCM9-HSCEI Futures Jun19

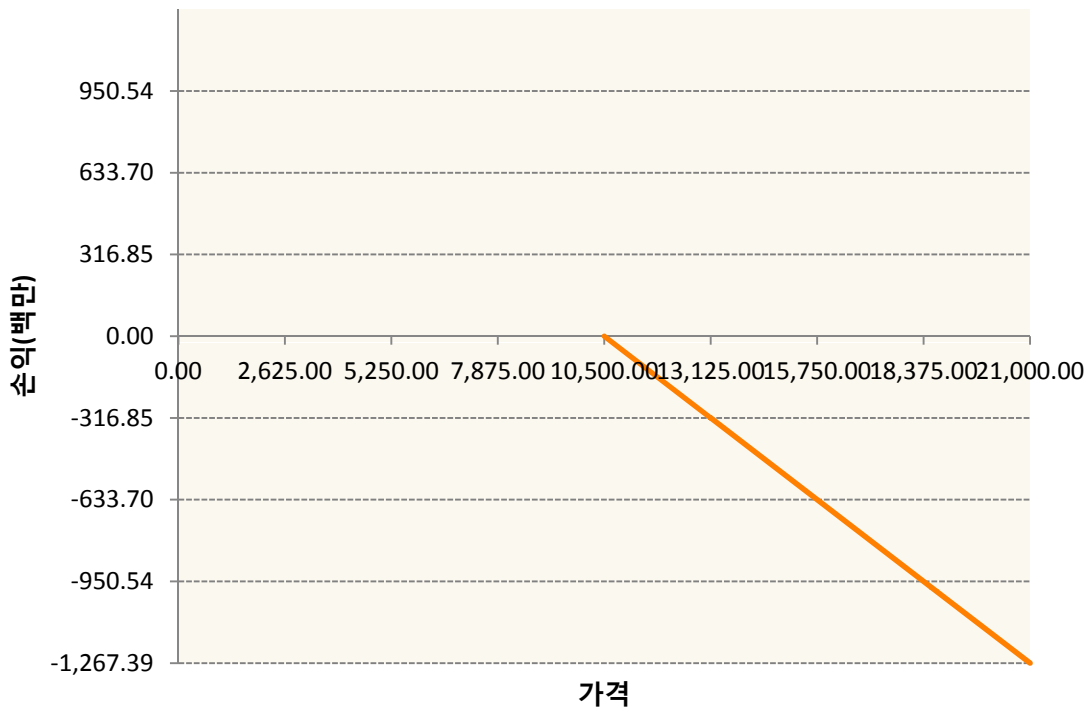


OHHIM9-C104-HSCEI

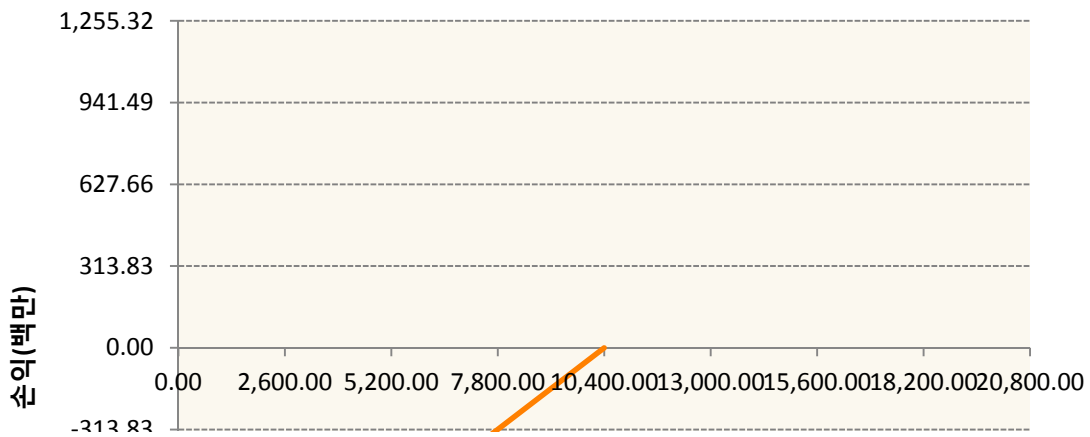


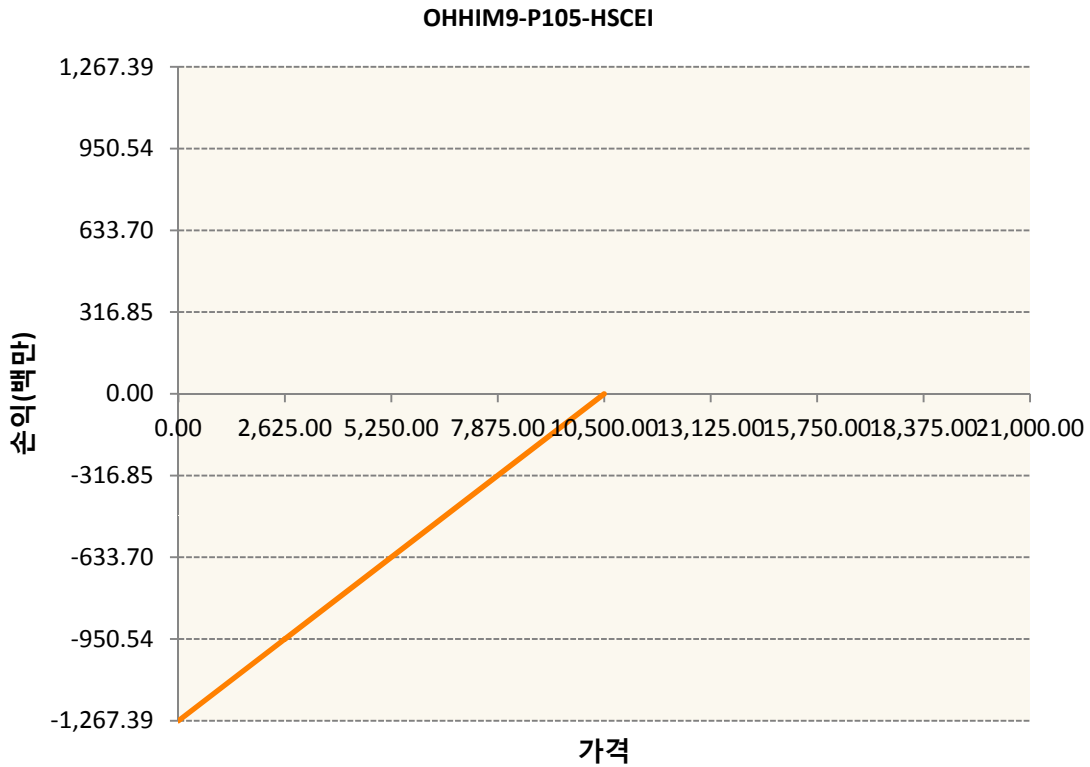


OHHIM9-C105-HSCEI



OHHIM9-P104-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019K02 KRW/HKD 23-08-19E	253
FX21019K03 HKD/KRW 23-08-19E	12
HCM9 HSCEI Futures Jun19	149
OHHIM9-C1 HSCEI	100
OHHIM9-C1 HSCEI	101
OHHIM9-P1 HSCEI	100
OHHIM9-P1 HSCEI	101

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	651

공시일	2019-06-05
기준일	2019-06-04

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

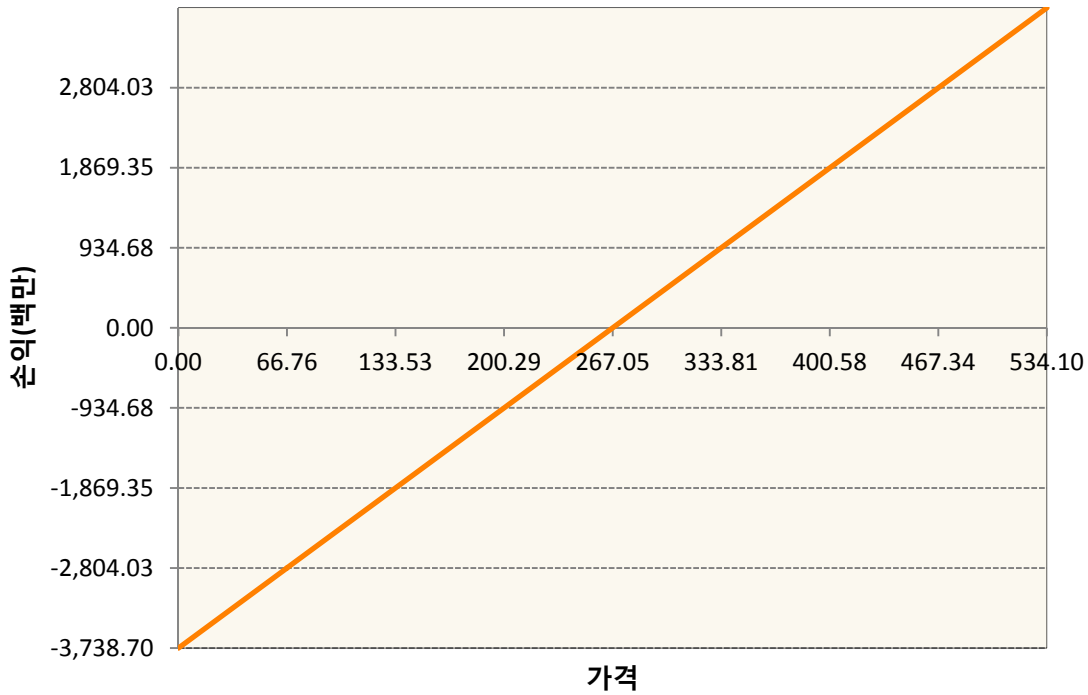
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

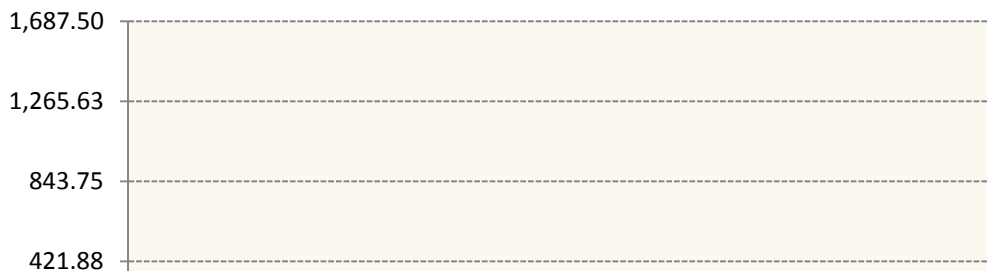
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,739	0	3,739	장내
누계	유가증권	스왑	20,836	0	20,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	21,759	-21,759	장내

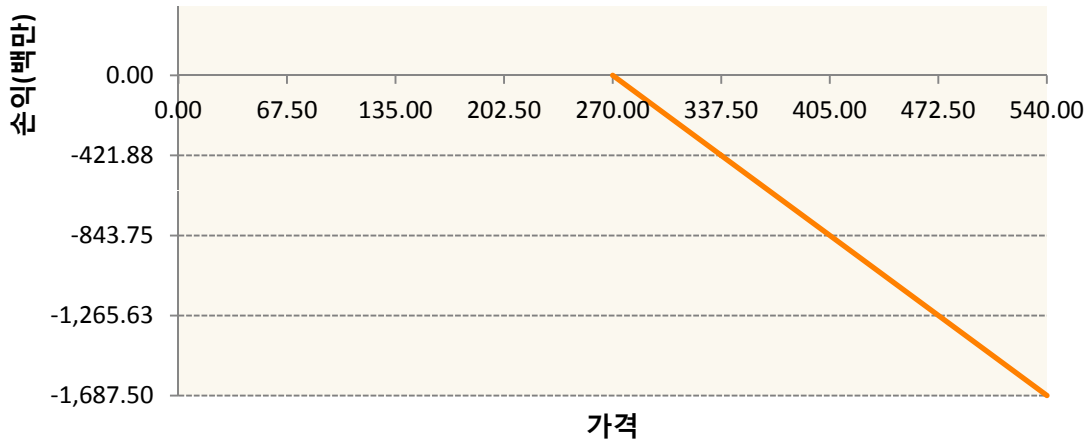
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

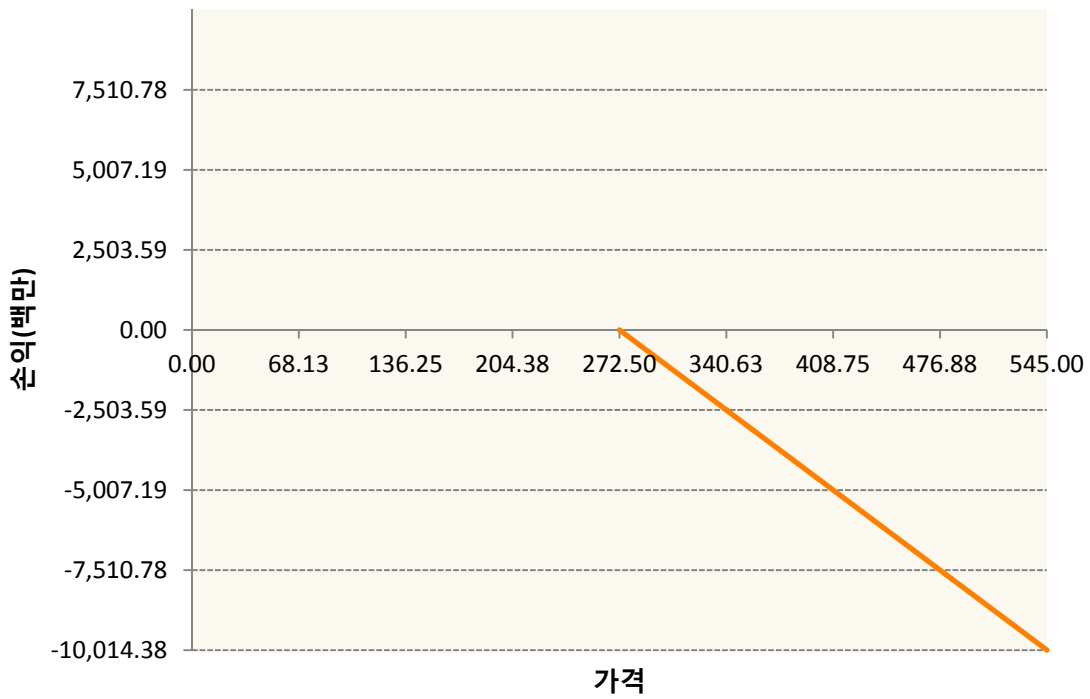


KR4201P62701-2019-06 콜270

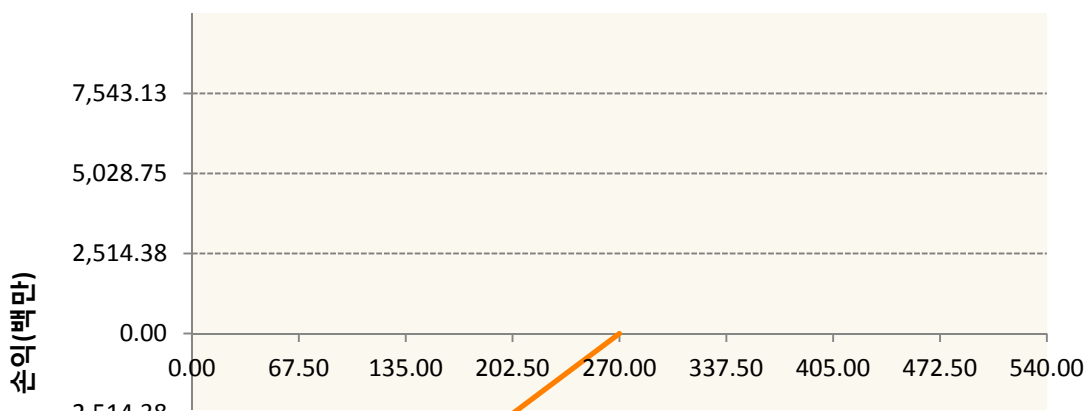


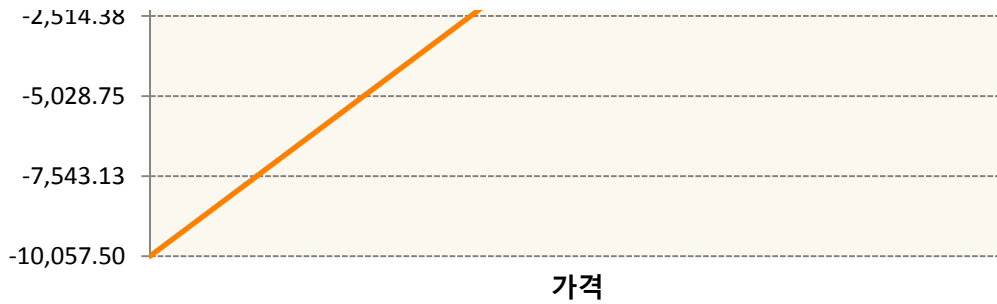


**KR4201P62727-2019-06 콜272.5**



**KR4301P62709-2019-06 풋270**





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						1,191
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,191	-1,191	-1,191	-1,191	-1,191	-1,191	-1,191	
-5.33%	-794	-794	-794	-794	-794	-794	-794	
-2.67%	-397	-397	-397	-397	-397	-397	-397	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	397	397	397	397	397	397	397	
5.33%	794	794	794	794	794	794	794	
8.00%	1,191	1,191	1,191	1,191	1,191	1,191	1,191	
2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_15						602
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-602	-602	-602	-602	-602	-602	-602	
-5.33%	-402	-402	-402	-402	-402	-402	-402	
-2.67%	-201	-201	-201	-201	-201	-201	-201	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	201	201	201	201	201	201	201	
5.33%	402	402	402	402	402	402	402	
8.00%	602	602	602	602	602	602	602	
KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						300
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-300	-300	-300	-300	-300	-300	-300	
-5.33%	-200	-200	-200	-200	-200	-200	-200	
-2.67%	-100	-100	-100	-100	-100	-100	-100	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	100	100	100	100	100	100	100	
5.33%	200	200	200	200	200	200	200	
8.00%	300	300	300	300	300	300	300	
KR4201P62701		2019-06 콜270						102
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	20	20	20	20	20	20	19
-5.33%	20	20	19	19	18	17	16
-2.67%	17	16	15	13	12	10	9
0%	7	4	2	0	-2	-4	-7
2.67%	-18	-20	-22	-24	-27	-29	-31
5.33%	-56	-57	-58	-59	-60	-62	-63
8.00%	-99	-99	-99	-100	-100	-101	-102

KR4201P62727                      2019-06 콜272.5                      552

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	86	86	86	86	85	84	82
-5.33%	86	85	83	81	78	74	70
-2.67%	77	72	67	60	52	44	36
0%	35	24	12	0	-12	-25	-37
2.67%	-81	-94	-107	-121	-134	-147	-161
5.33%	-279	-287	-295	-305	-315	-325	-336
8.00%	-523	-526	-529	-534	-539	-545	-552

KR4301P62709                      2019-06 풋270                      727

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-727	-727	-727	-727	-727	-727	-727
-5.33%	-461	-461	-461	-462	-463	-464	-465
-2.67%	-199	-201	-204	-207	-211	-216	-221
0%	25	17	9	0	-9	-17	-26
2.67%	137	130	123	116	108	100	92
5.33%	159	157	155	153	150	146	142
8.00%	160	160	160	159	159	158	157

**4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)**

(단위:백만원)

**3,587**

공시일	2019-06-05
기준일	2019-06-04

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

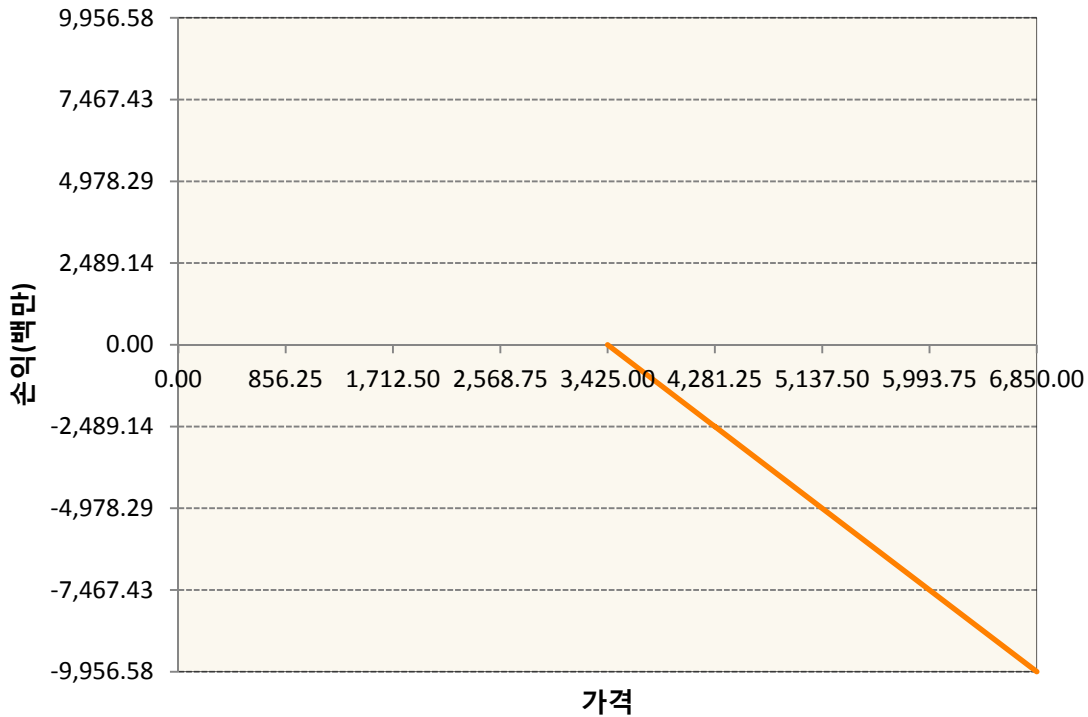
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,597	0	3,597	
누계	유가증권	스왑	56,448	0	56,448	장외
누계	유가증권	옵션	0	20,465	-20,465	장내
누계	통화	선도	0	18,670	-18,670	장외

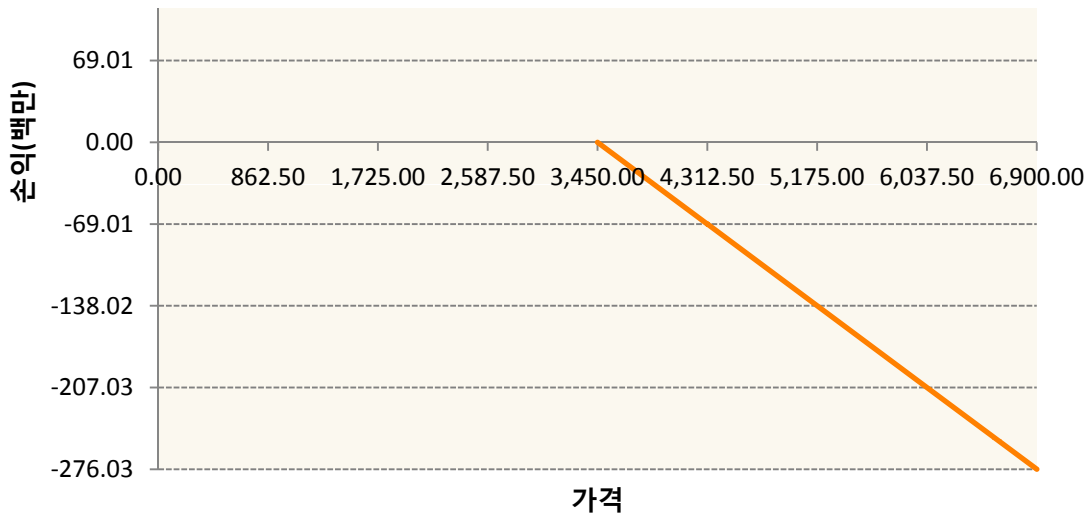
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXM9-C3425-EURO STOXX 50**

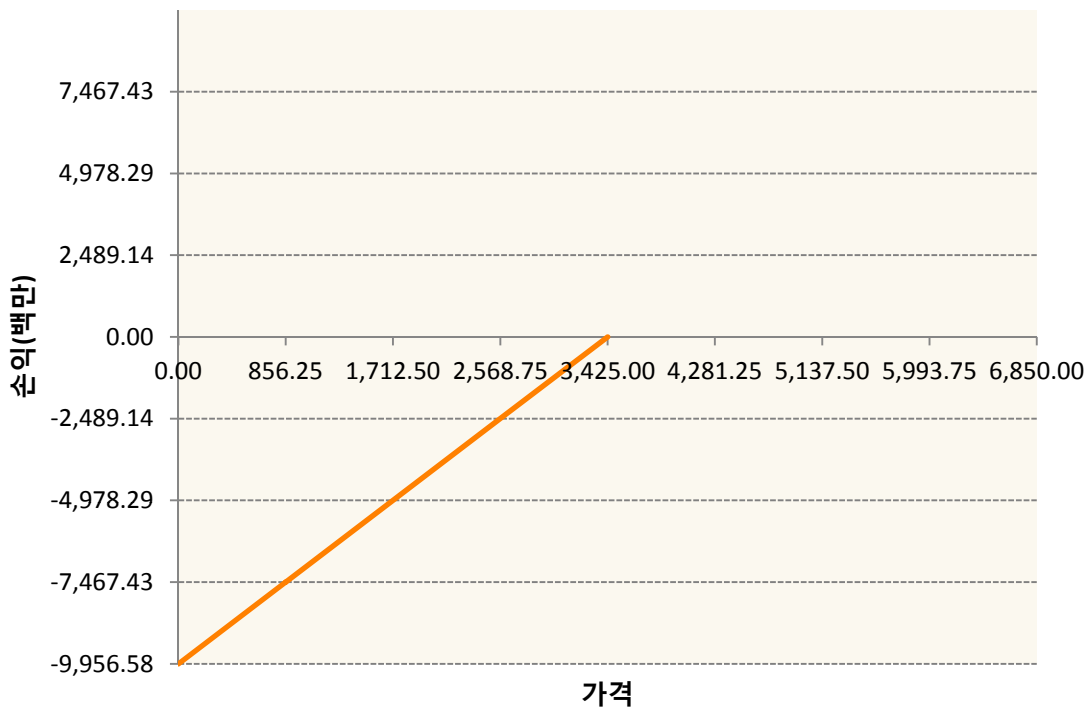


**OESXM9-C3450-EURO STOXX 50**

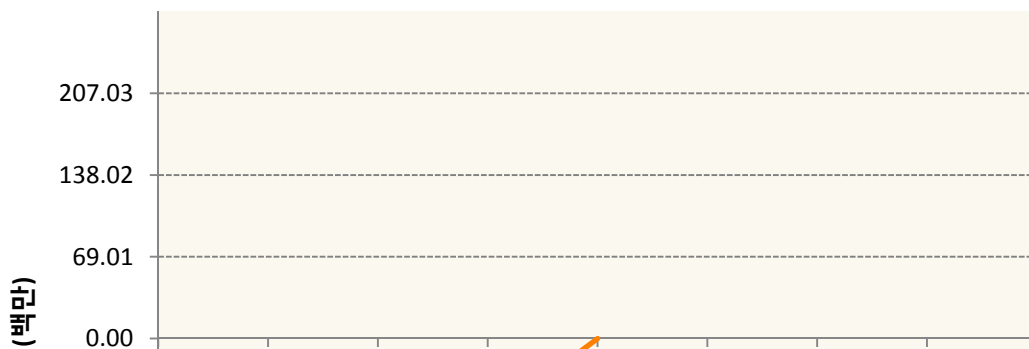


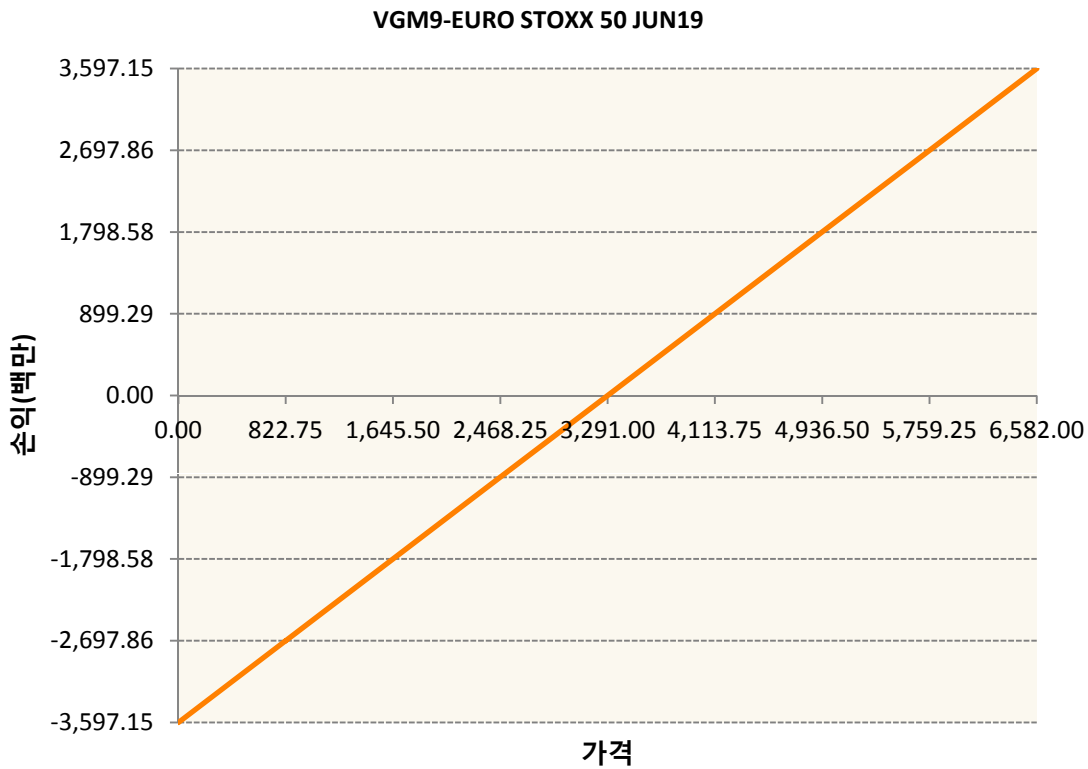
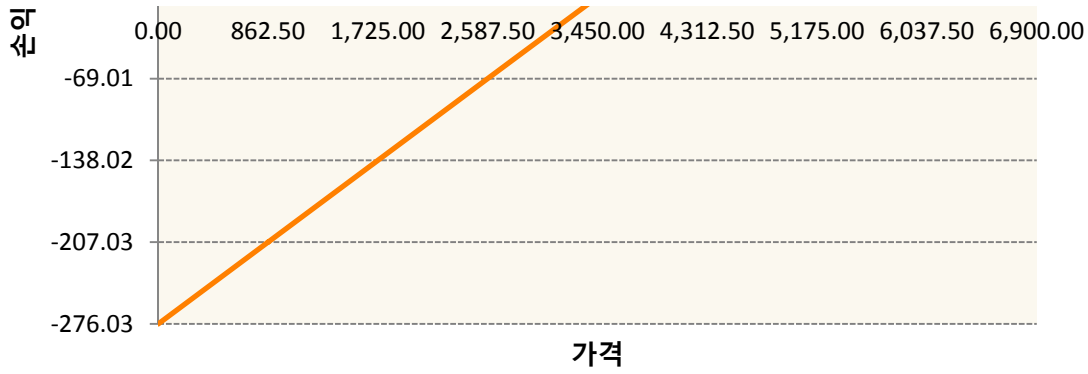


OESXM9-P3425-EURO STOXX 50



OESXM9-P3450-EURO STOXX 50





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	124
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	853
FX21019J01 KRW/EUR 28-06-19E	213
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	427
OESXM9-C3 EURO STOXX 50	797
OESXM9-C3 EURO STOXX 50	22
OESXM9-P3 EURO STOXX 50	797
OESXM9-P3 EURO STOXX 50	22
VGM9 EURO STOXX 50 JUN19	288

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

2,270



4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

1,031



4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

91



4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

132



4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

41

공시일	2019-06-05
기준일	2019-06-04

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

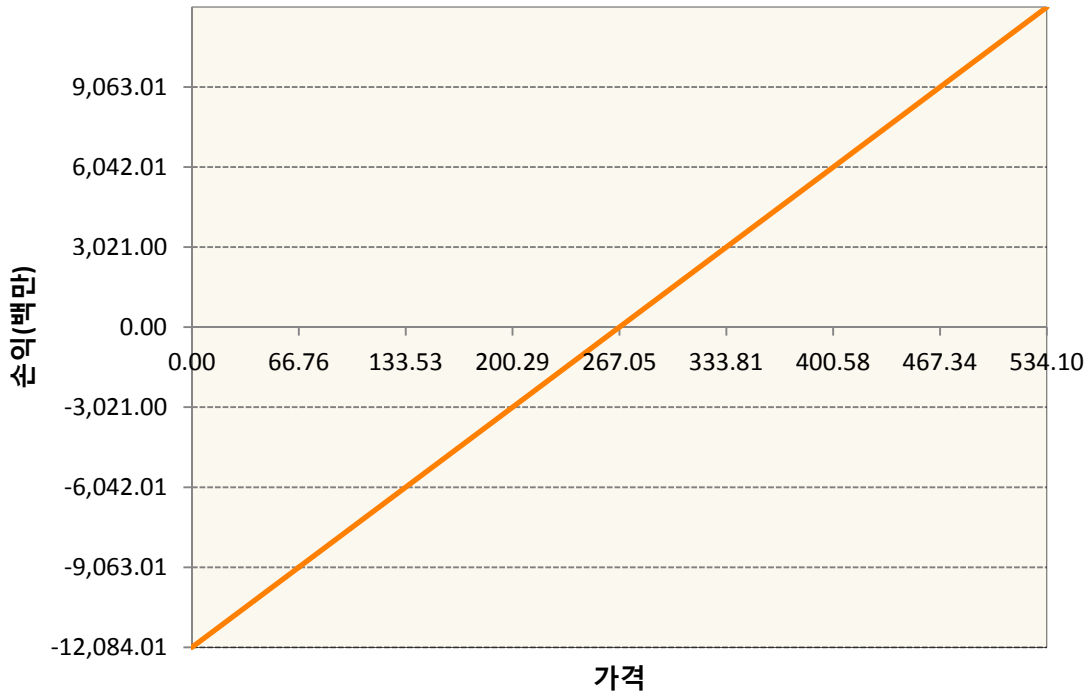
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

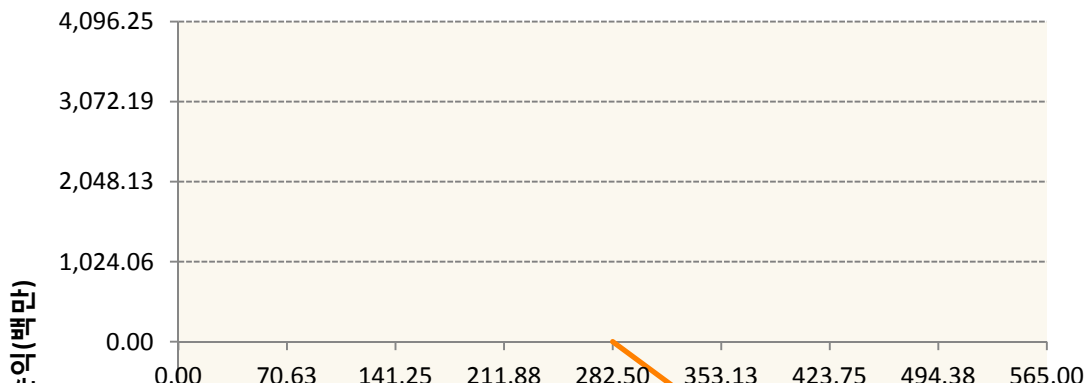
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,084	0	12,084	장내
누계	유가증권	옵션	5,081	22,906	-17,825	장내

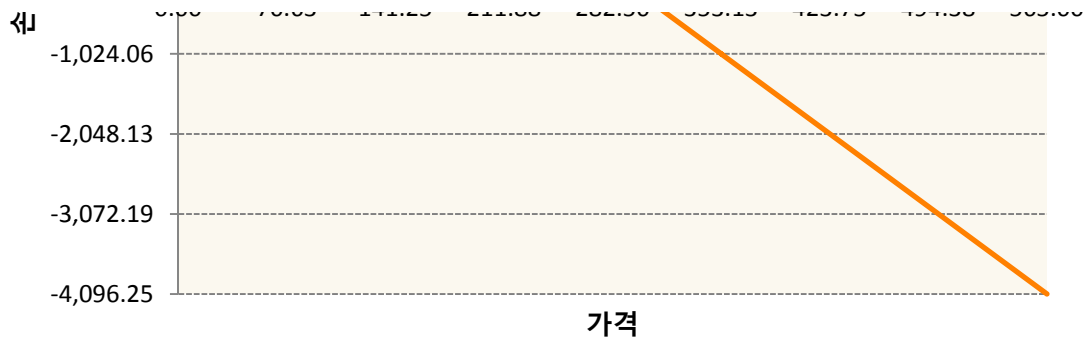
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

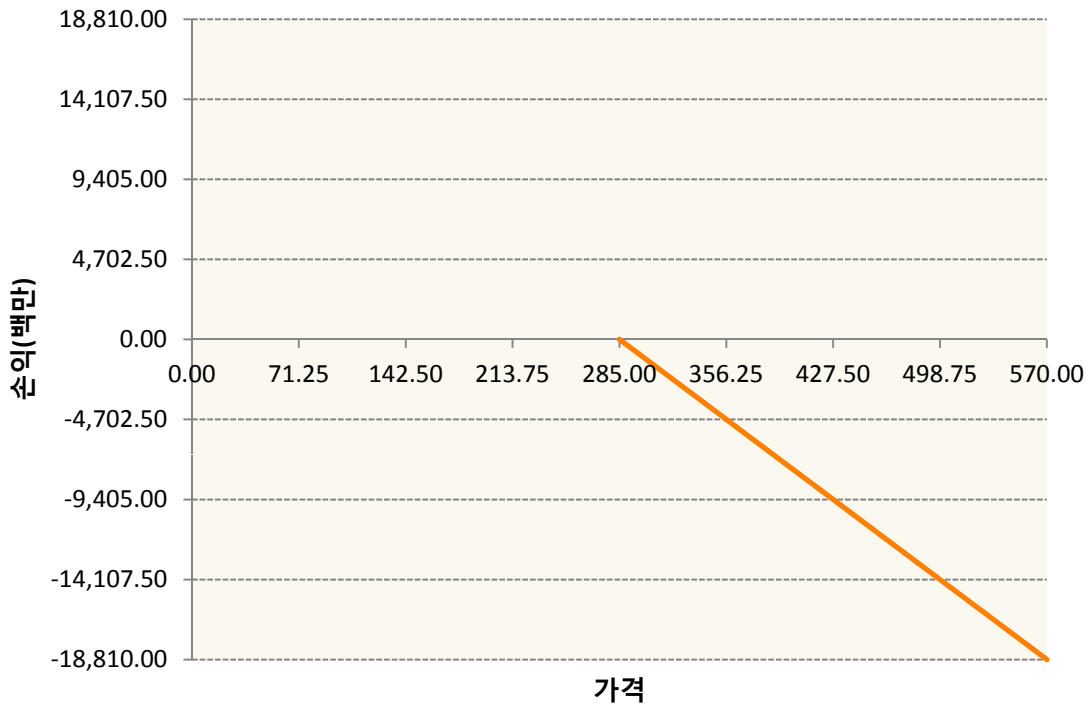


KR4201P62826-2019-06 콜282.5

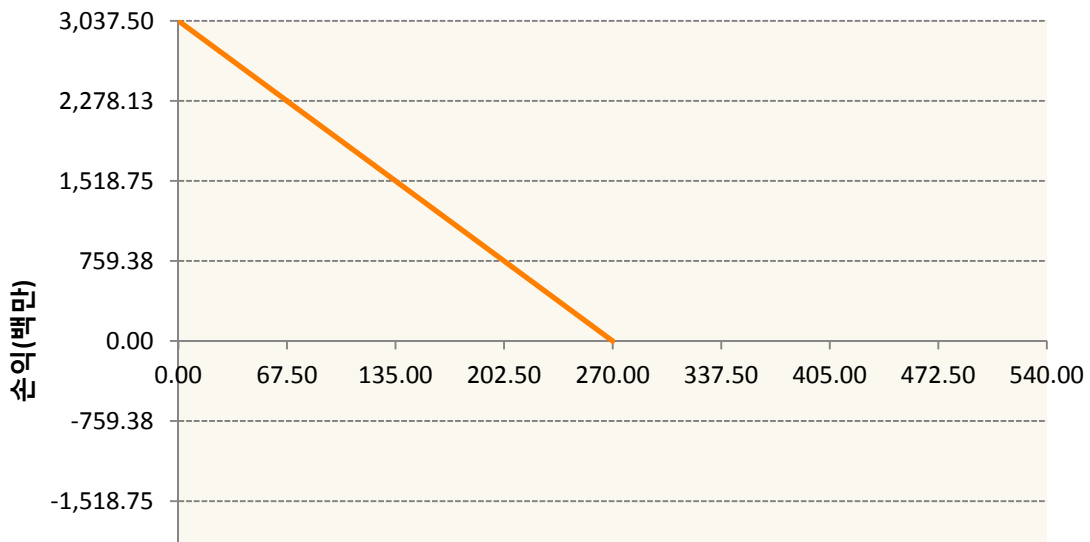


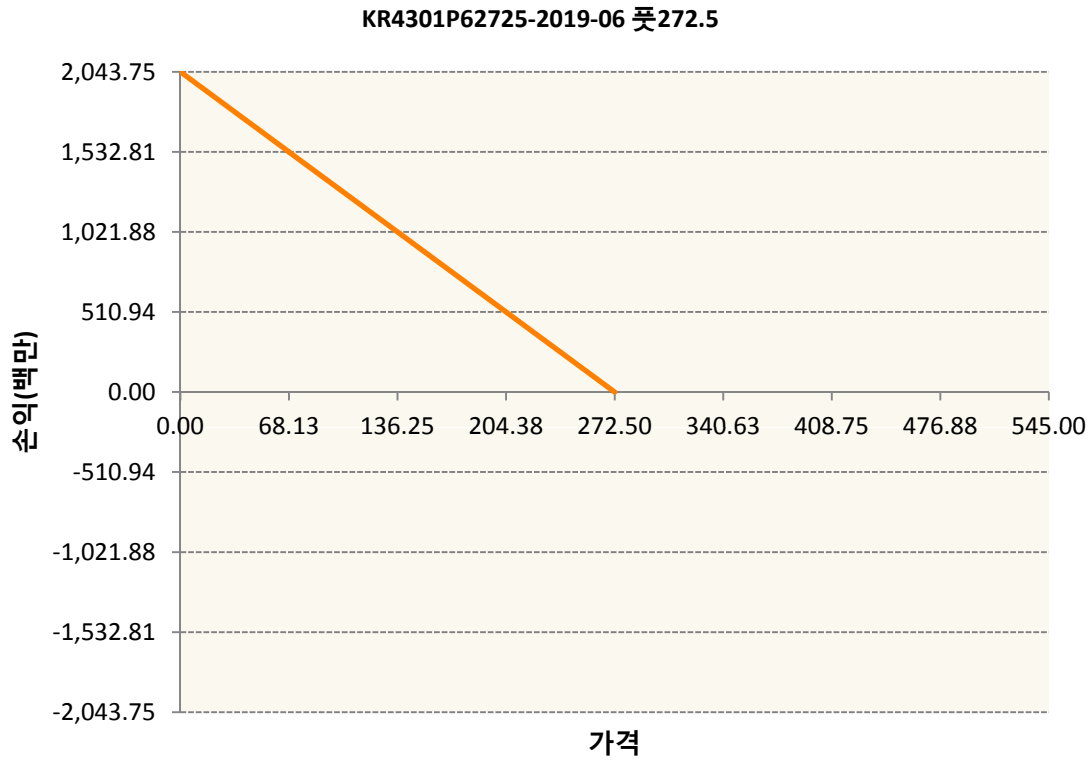
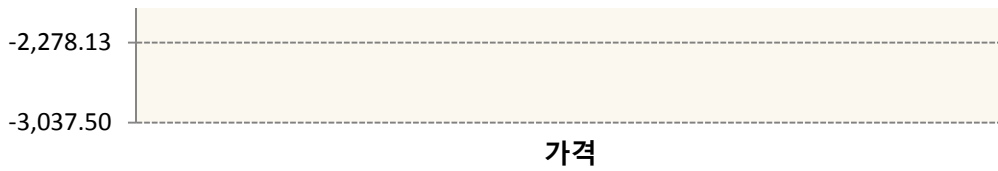


KR4201P62859-2019-06 콜285



KR4301P62709-2019-06 풋270





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						969
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-969	-969	-969	-969	-969	-969	-969	
-5.33%	-646	-646	-646	-646	-646	-646	-646	
-2.67%	-323	-323	-323	-323	-323	-323	-323	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	323	323	323	323	323	323	323	
5.33%	646	646	646	646	646	646	646	
8.00%	969	969	969	969	969	969	969	
KR4201P62826		2019-06 콜282.5						132
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	7	7	7	7	7	7	7	
-5.33%	7	7	7	7	6	6	6	
-2.67%	7	6	6	5	5	4	2	

0%	5	4	2	0	-2	-5	-8
2.67%	-5	-9	-13	-17	-22	-26	-31
5.33%	-38	-44	-49	-55	-60	-66	-71
8.00%	-104	-108	-113	-118	-123	-127	-132
KR4201P62859                      2019-06 콜285							511
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	19	19	19	19	19	19	19
-5.33%	19	19	19	19	18	17	16
-2.67%	19	18	18	16	13	10	5
0%	15	12	7	0	-8	-18	-28
2.67%	-12	-25	-40	-56	-73	-91	-109
5.33%	-119	-143	-167	-191	-216	-240	-265
8.00%	-367	-390	-414	-438	-462	-486	-511
KR4301P62709                      2019-06 풋270							220
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	219	219	219	219	219	220	220
-5.33%	139	139	139	139	140	140	140
-2.67%	60	61	62	63	64	65	67
0%	-8	-5	-3	0	3	5	8
2.67%	-41	-39	-37	-35	-33	-30	-28
5.33%	-48	-47	-47	-46	-45	-44	-43
8.00%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-47
KR4301P62725                      2019-06 풋272.5							152
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	152	152	152	152	152	152	152
-5.33%	99	99	99	99	99	99	99
-2.67%	45	45	46	46	47	47	48
0%	-4	-3	-1	0	2	3	5
2.67%	-35	-34	-32	-30	-28	-27	-25
5.33%	-44	-44	-43	-42	-41	-40	-39
8.00%	-45	-45	-45	-45	-45	-44	-44

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

1,465

공시일	2019-06-05
기준일	2019-06-04

## H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	17,805	0	17,805	

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

### 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2019-06-05
기준일	2019-06-04

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	56,700	0	56,700	

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

### 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2019-06-05
기준일	2019-06-04

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	318,044	0	318,044	
누계	통화	선도	0	335,442	-335,442	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
IE00BHNZKL13	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019J004 KRW/USD 10-06-19E		104
FX21019J019 KRW/USD 18-06-19E		378
FX21019J024 KRW/USD 24-06-19E		946
FX21019J034 KRW/USD 26-06-19E		378
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		76
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		995
FX21019J037 KRW/USD 26-06-19E		1,022
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		284
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		473
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		662
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		662
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		823
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		814
FX21019K00 KRW/USD 18-06-19E		568
FX21019K01 KRW/USD 14-06-19E		662
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		568
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		473
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		568
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		1,419
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		1,325
FX21019K01 KRW/USD 22-07-19E		473
FX21019K01 KRW/USD 20-06-19E		795
FX21019K01 KRW/USD 20-06-19E		632
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		473
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		378
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		795

FX21019K02 KRW/USD 24-06-19E	378
FX21019K03 KRW/USD 24-06-19E	946
FX21019K03 KRW/USD 24-06-19E	1,514
FX21019K03 KRW/USD 28-06-19E	284
FX21019K03 KRW/USD 28-06-19E	1,230
FX21019K04 KRW/USD 28-06-19E	1,287
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E	662
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E	568
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E	757
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E	757
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E	473
FX21019M0( KRW/USD 10-07-19E	284
FX21019M0( KRW/USD 10-07-19E	946

**4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)**

(단위:백만원)

**9,021**

공시일	2019-06-05
기준일	2019-06-04

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

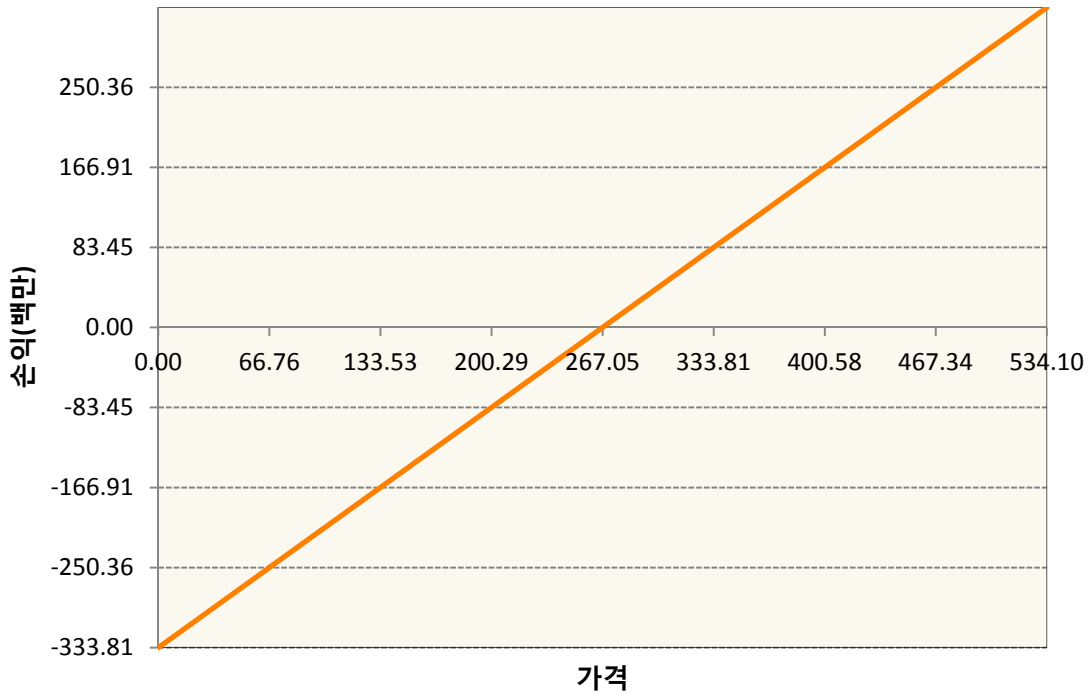
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

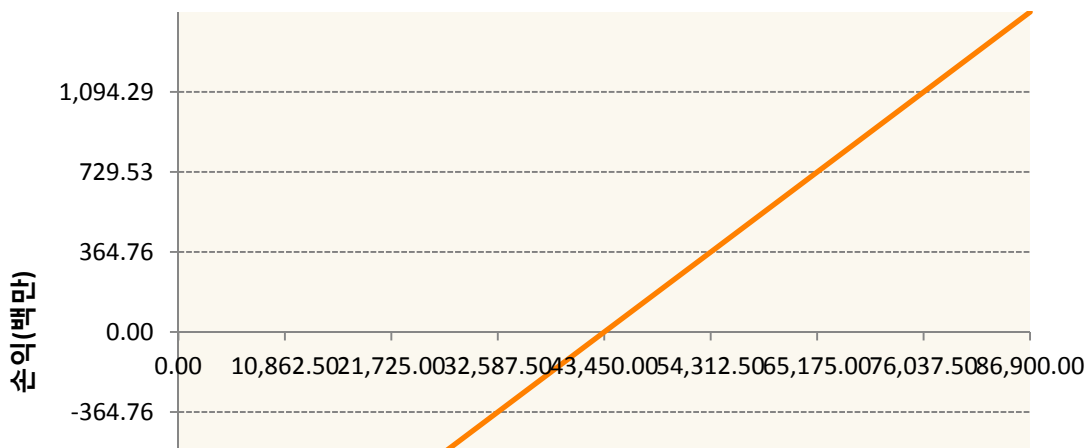
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,793	0	1,793	장내

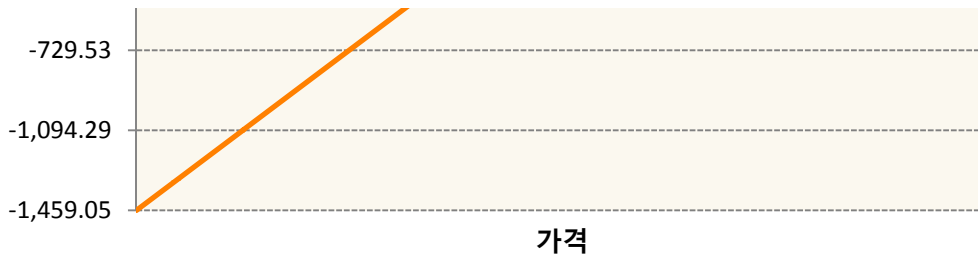
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



KR4111P60003-2019-06 삼성전자개별선물





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						27
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27	
-5.33%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18	
-2.67%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	9	9	9	9	9	9	9	
5.33%	18	18	18	18	18	18	18	
8.00%	27	27	27	27	27	27	27	
KR4111P60003		2019-06 삼성전자개별선물						117
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-117	-117	-117	-117	-117	-117	-117	
-5.33%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78	
-2.67%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	39	39	39	39	39	39	39	
5.33%	78	78	78	78	78	78	78	
8.00%	117	117	117	117	117	117	117	

**4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)** (단위:백만원)

**161**

공시일	2019-06-05
기준일	2019-06-04

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

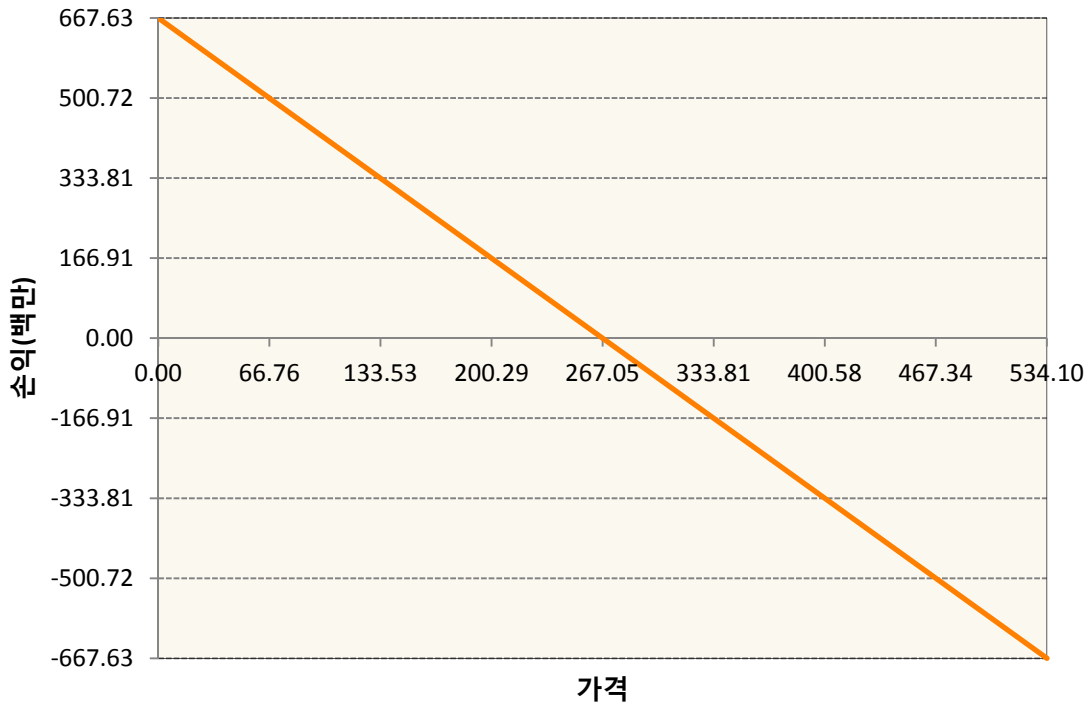
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

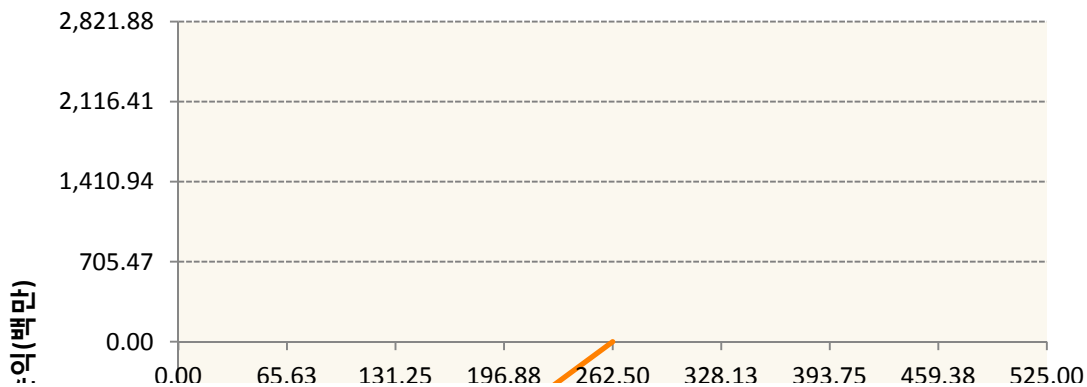
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	668	-668	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,286	-3,286	장내

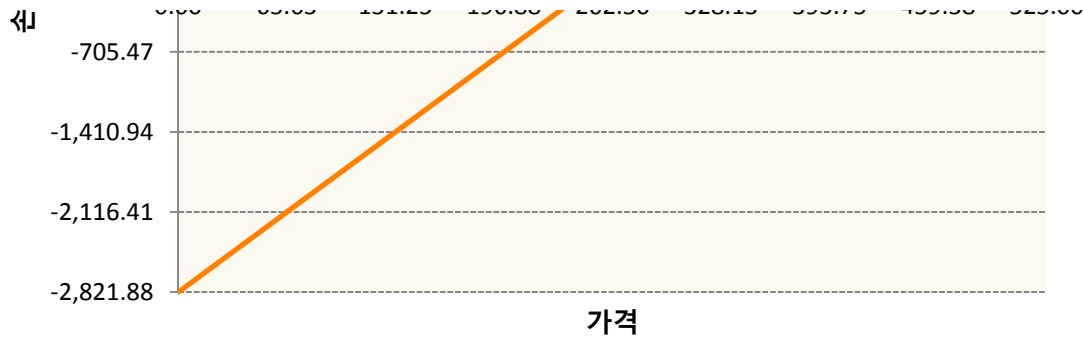
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

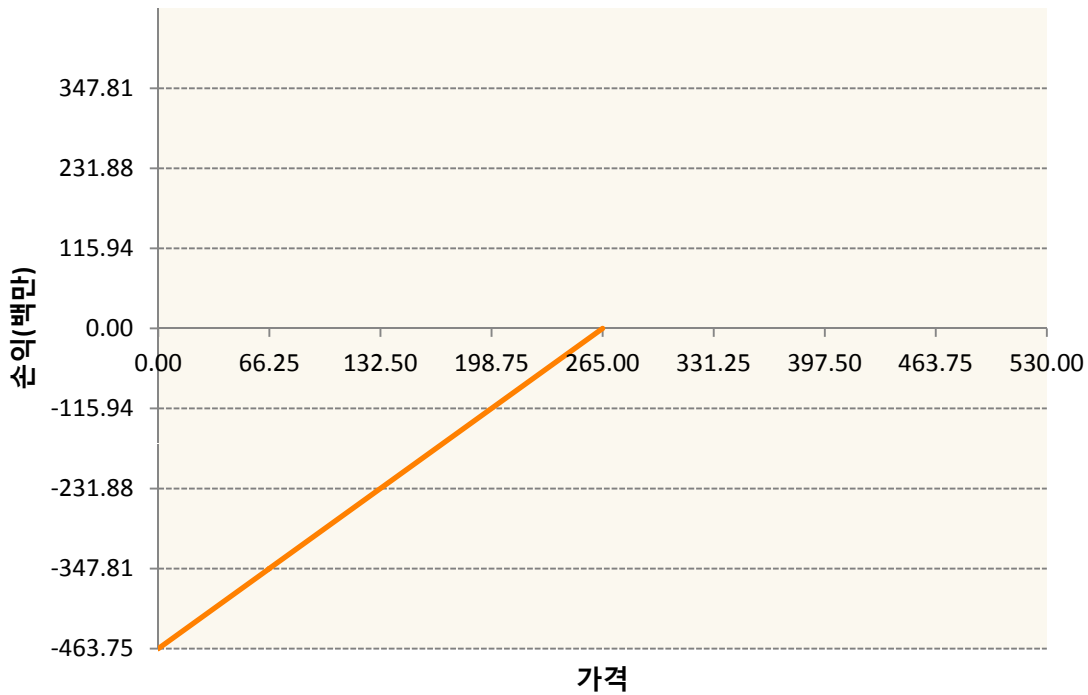


KR4301P62626-2019-06 풋262.5





KR4301P62659-2019-06 풋265



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						54
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	54	54	54	54	54	54	54	
-5.33%	36	36	36	36	36	36	36	
-2.67%	18	18	18	18	18	18	18	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18	
5.33%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36	
8.00%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54	
KR4301P62626		2019-06 풋262.5						165
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-164	-164	-164	-164	-165	-165	-165
-5.33%	-88	-89	-90	-91	-92	-93	-95
-2.67%	-25	-27	-29	-32	-34	-37	-39
0%	6	4	2	0	-2	-4	-6
2.67%	11	11	10	10	9	8	7
5.33%	11	11	11	11	11	11	10
8.00%	11	11	11	11	11	11	11
KR4301P62659                      2019-06 풋265							30
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
-5.33%	-17	-17	-17	-18	-18	-18	-18
-2.67%	-6	-6	-6	-7	-7	-8	-8
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	3	3	3	3	2	2	2
5.33%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	3	3	3	3	3	3	3

**4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)**

(단위:백만원)

**242**

공시일	2019-06-05
기준일	2019-06-04

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

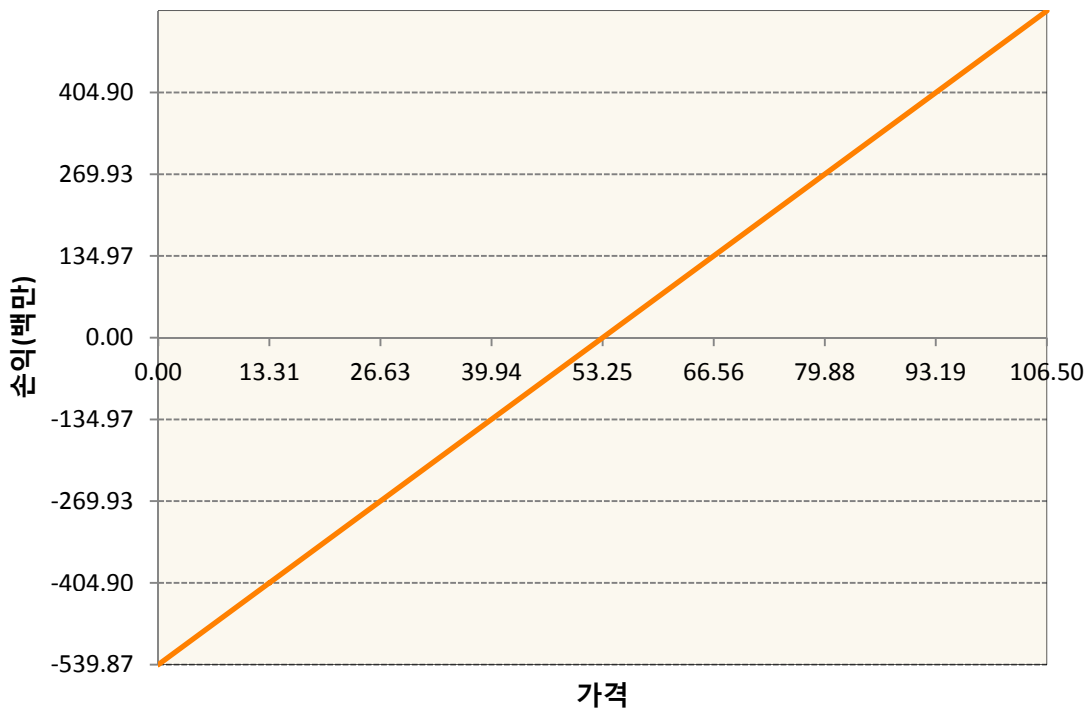
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

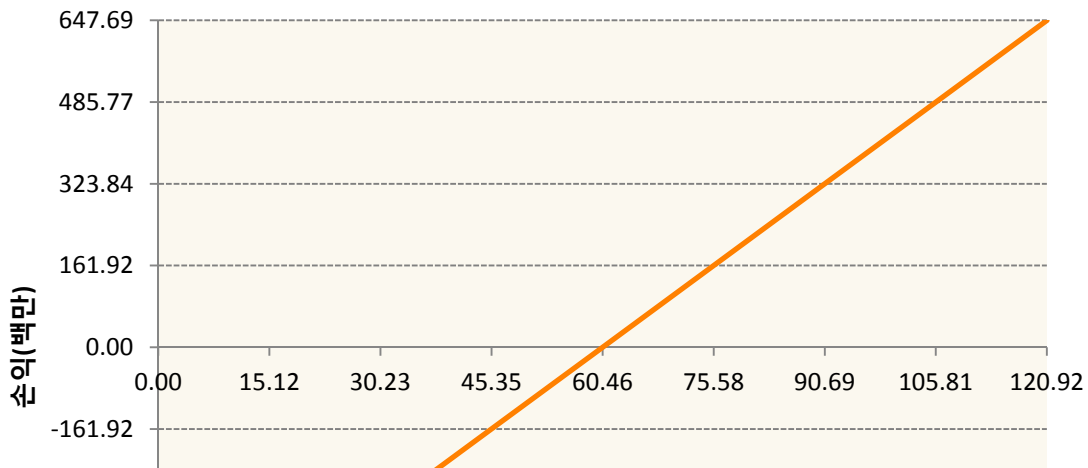
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,431	118	2,313	

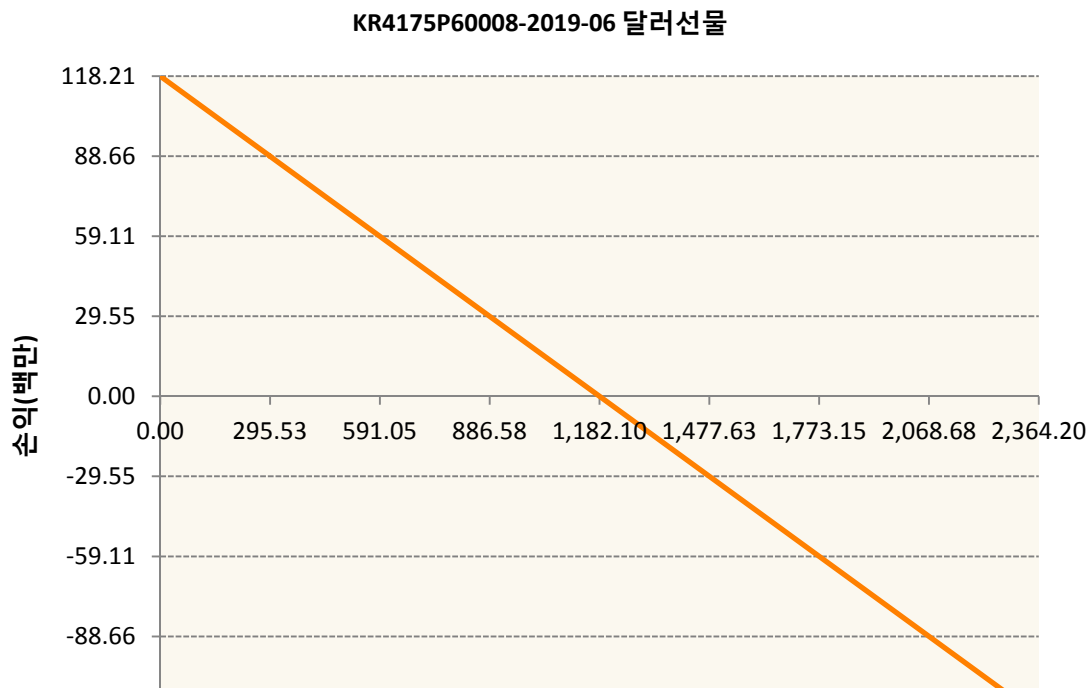
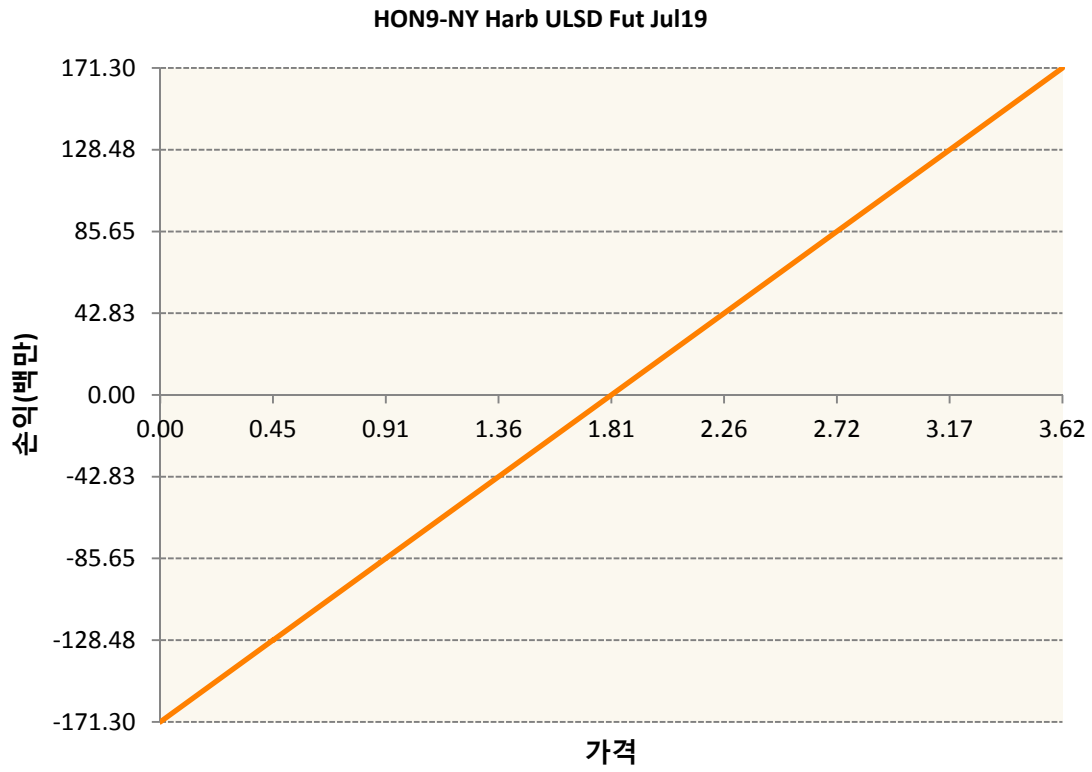
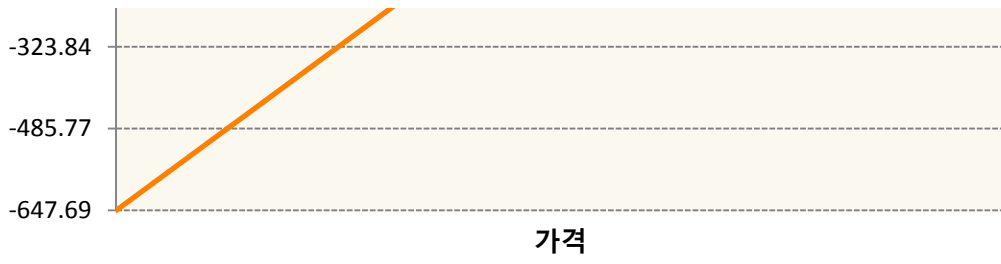
### 2. 만기시점의 손익구조

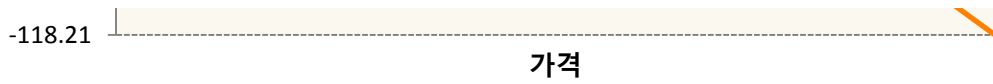
CLN9-WTI CRUDE FUTURE Jul19



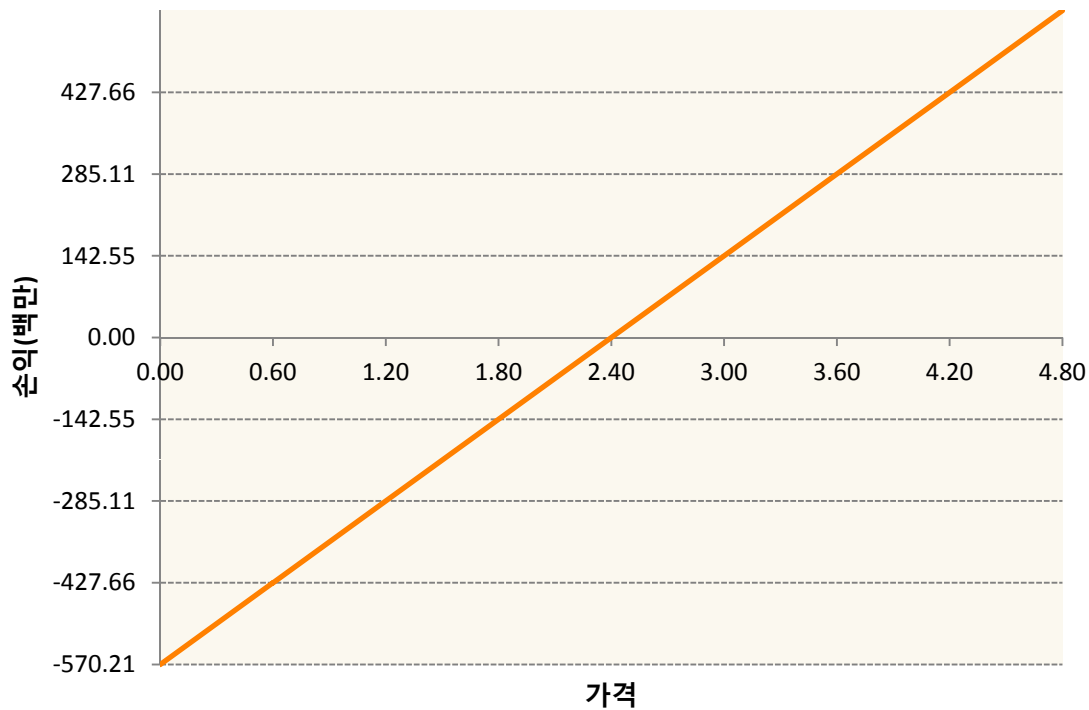
COU9-BRENT CRUDE FUTR Sep19



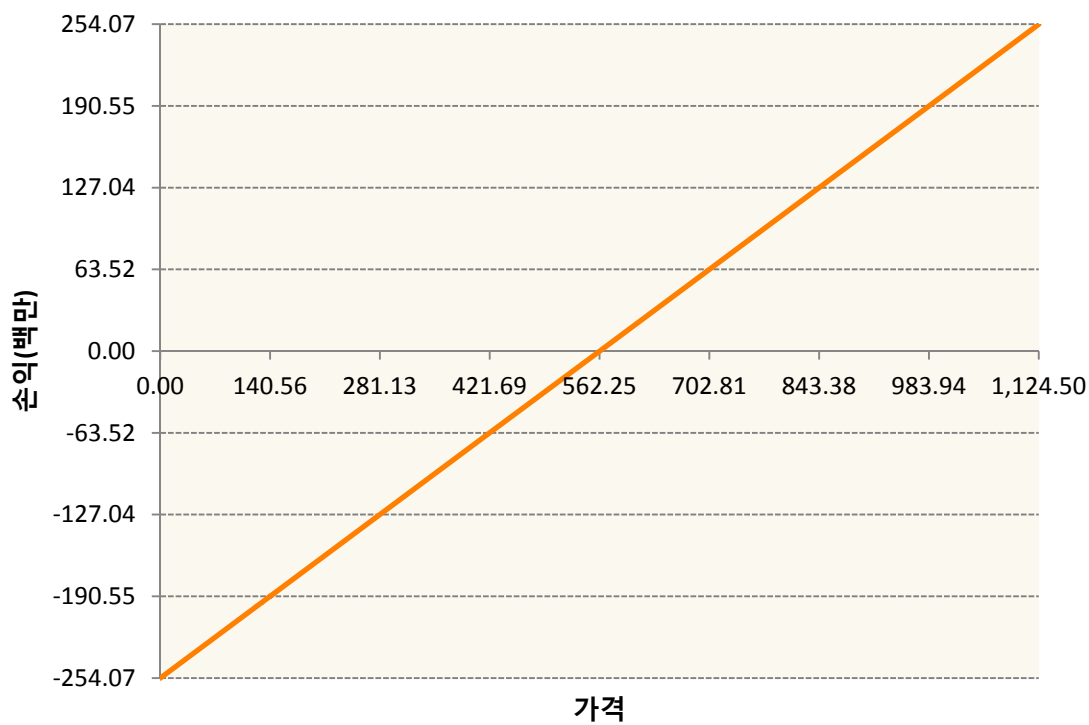




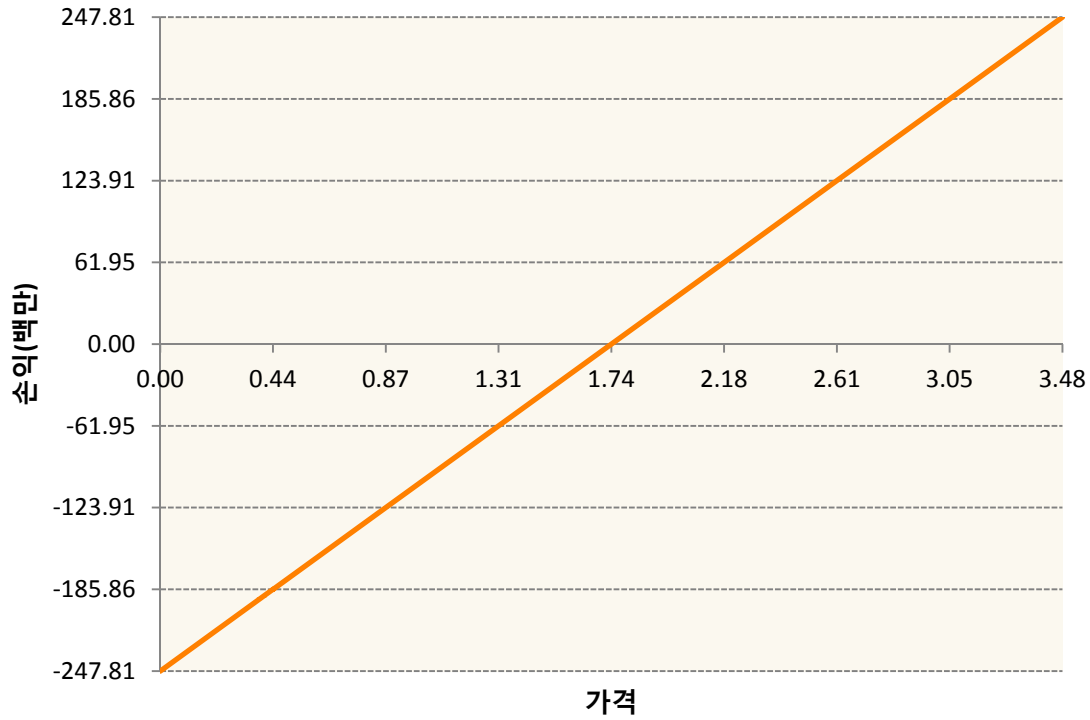
NGN19-NATURAL GAS FUTR Jul19



QSN9-Low Su Gasoil G Jul19



XBN9-GASOLINE RBOB FUT Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLN9	WTI CRUDE FUTURE Jul19	43
COU9	BRENT CRUDE FUTR Sep19	52
HON9	NY Harb ULSD Fut Jul19	14
KR4175P600	2019-06 달러선물	9
NGN19	NATURAL GAS FUTR Jul19	46
QSN9	Low Su Gasoil G Jul19	20
XBN9	GASOLINE RBOB FUT Jul19	20

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

360

공시일	2019-06-05
기준일	2019-06-04

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

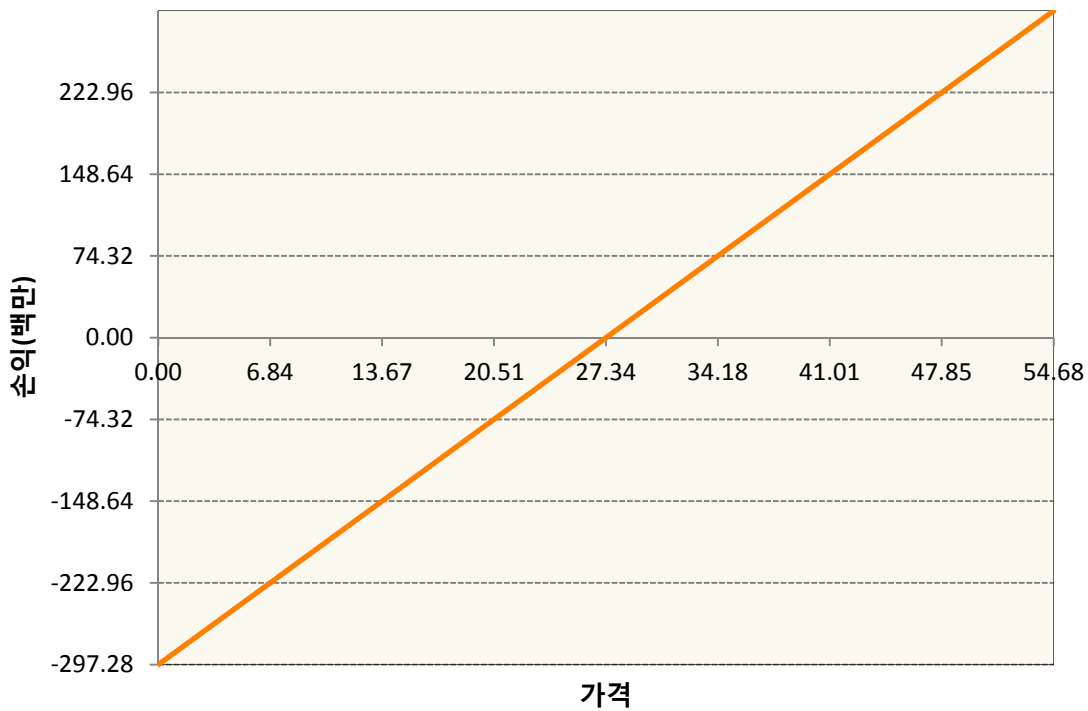
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

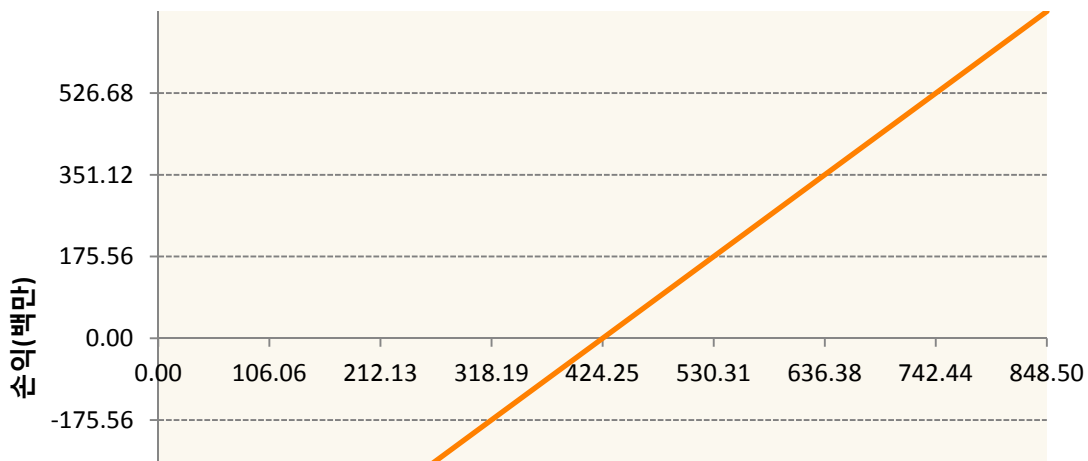
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,132	201	2,931	

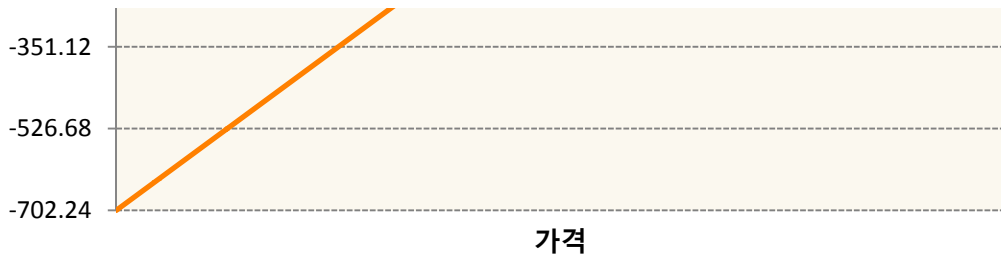
### 2. 만기시점의 손익구조

**BON9-SOYBEAN OIL FUTR Jul19**

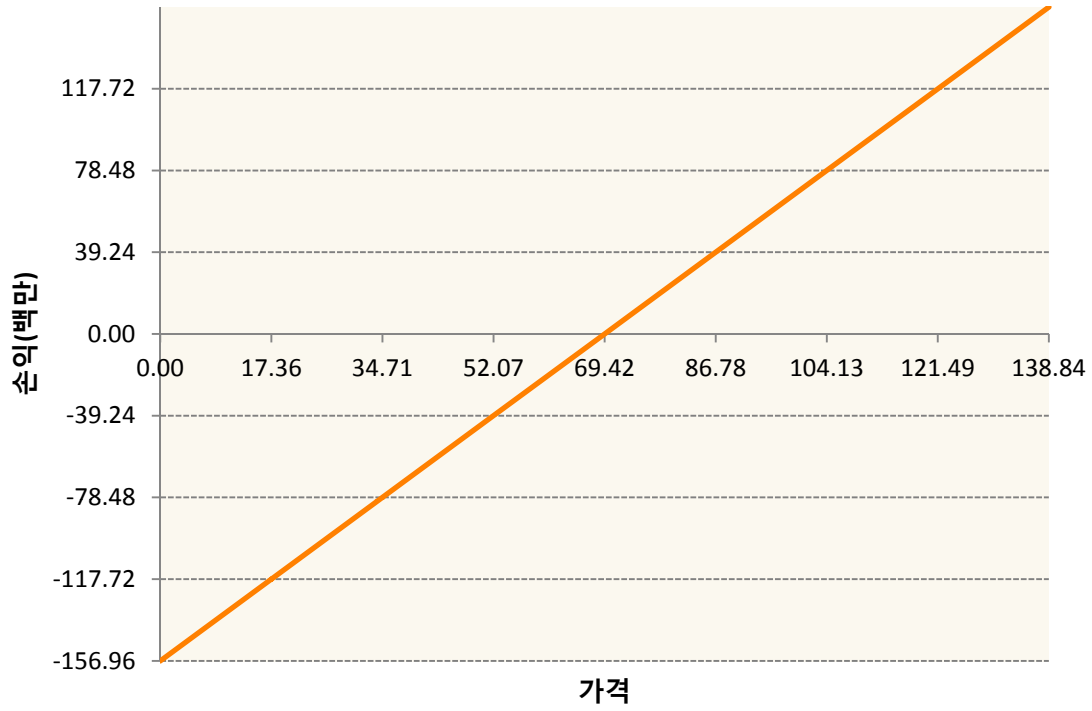


**CN9-CORN FUTURE Jul19**

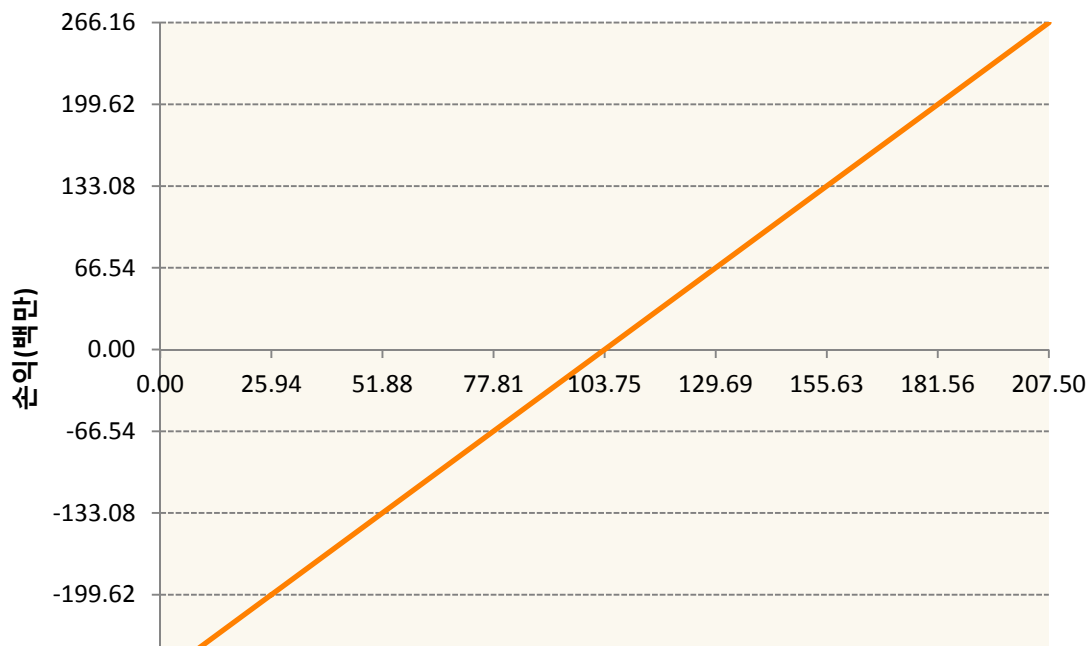


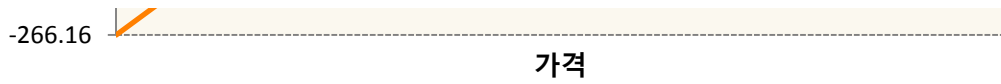


CTN9-COTTON NO.2 FUTR Jul19

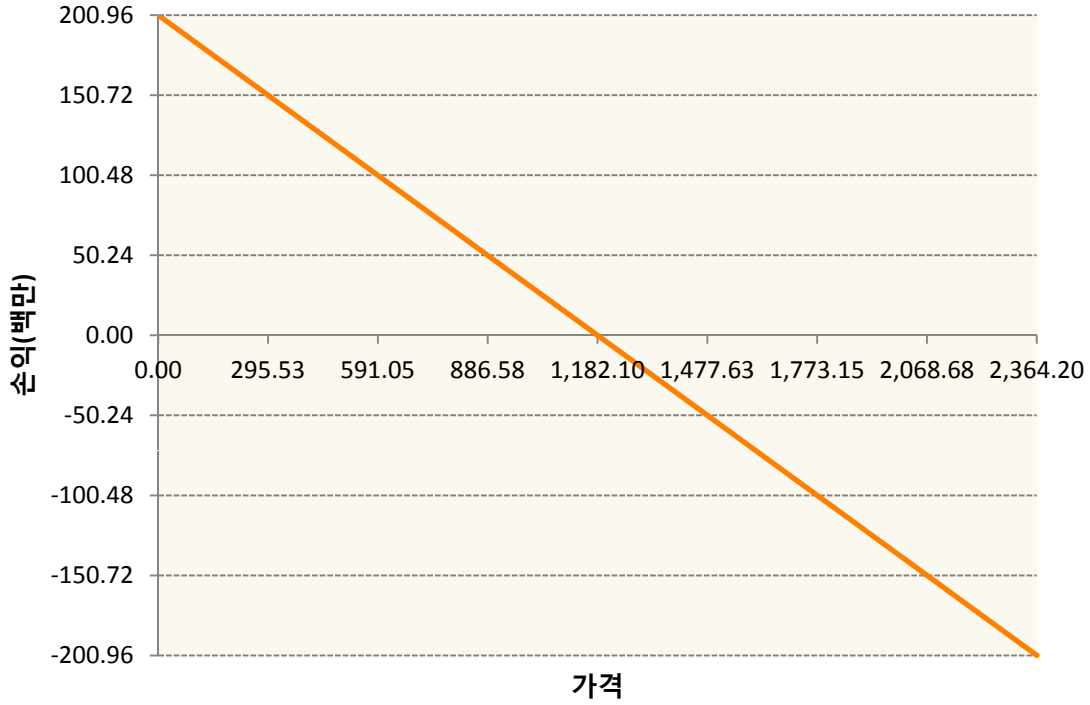


KCN9-COFFEE 'C' FUTURE Jul19

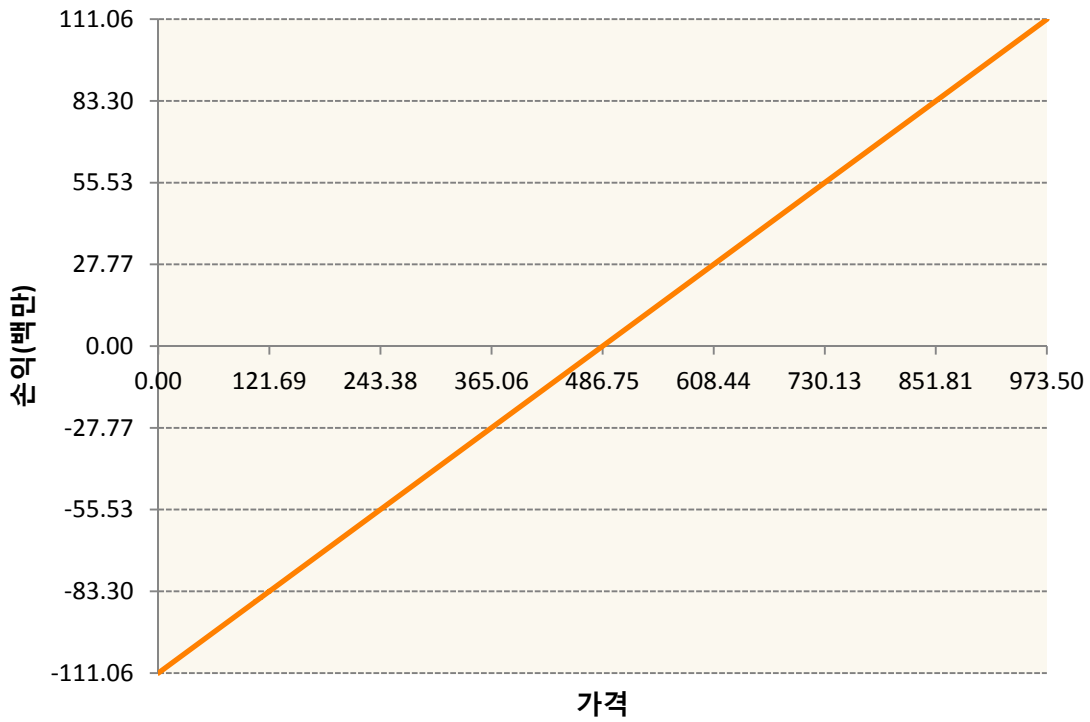




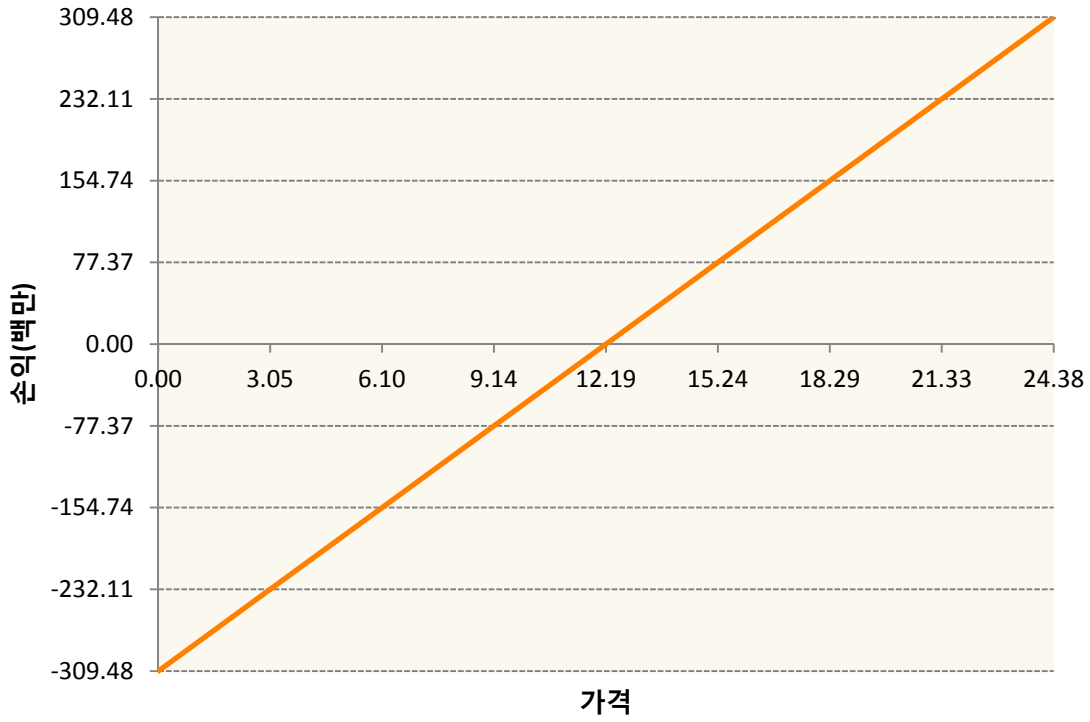
KR4175P60008-2019-06 달러선물



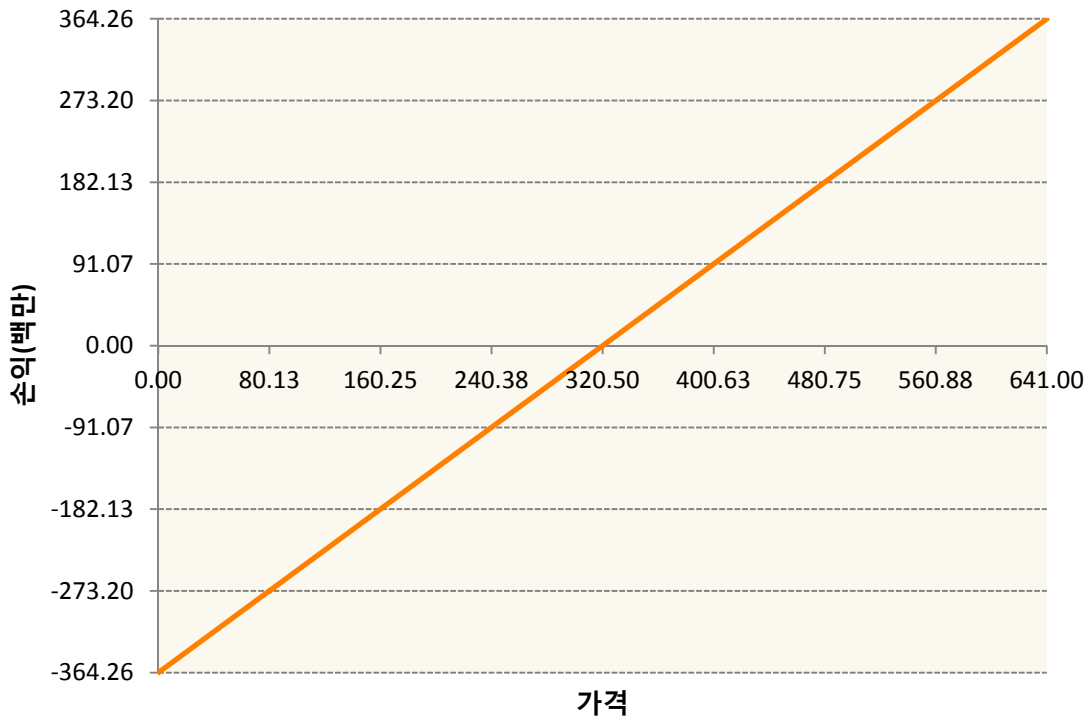
KWN9-KC HRW WHEAT FUT Jul19



SBN9-SUGAR #11 (WORLD) Jul19

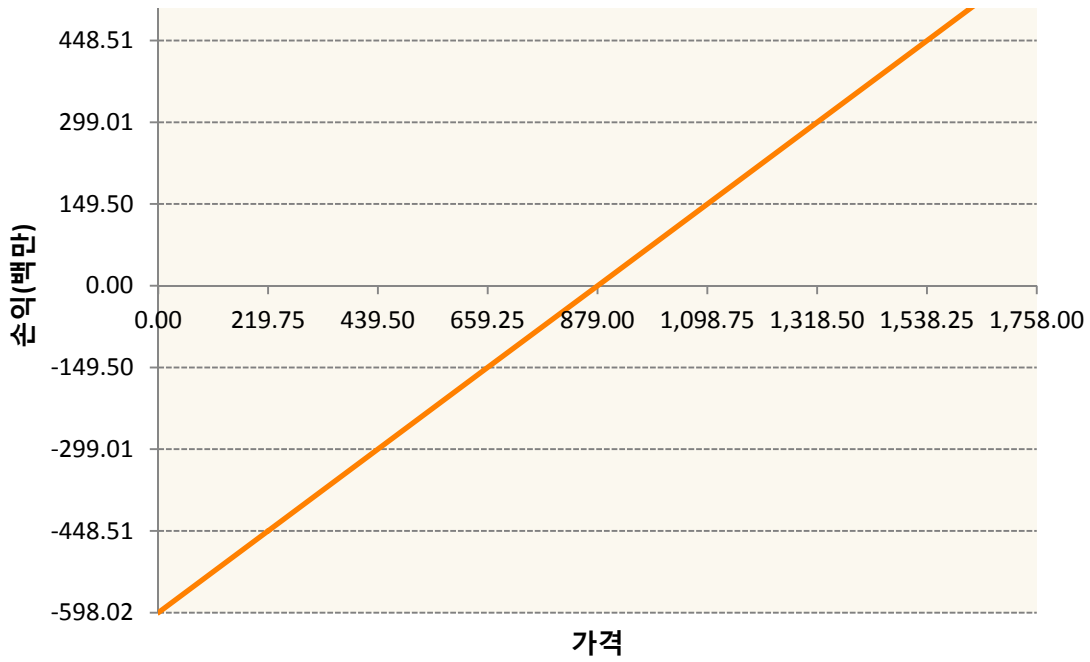


SMN9-SOYBEAN MEAL FUTR Jul19

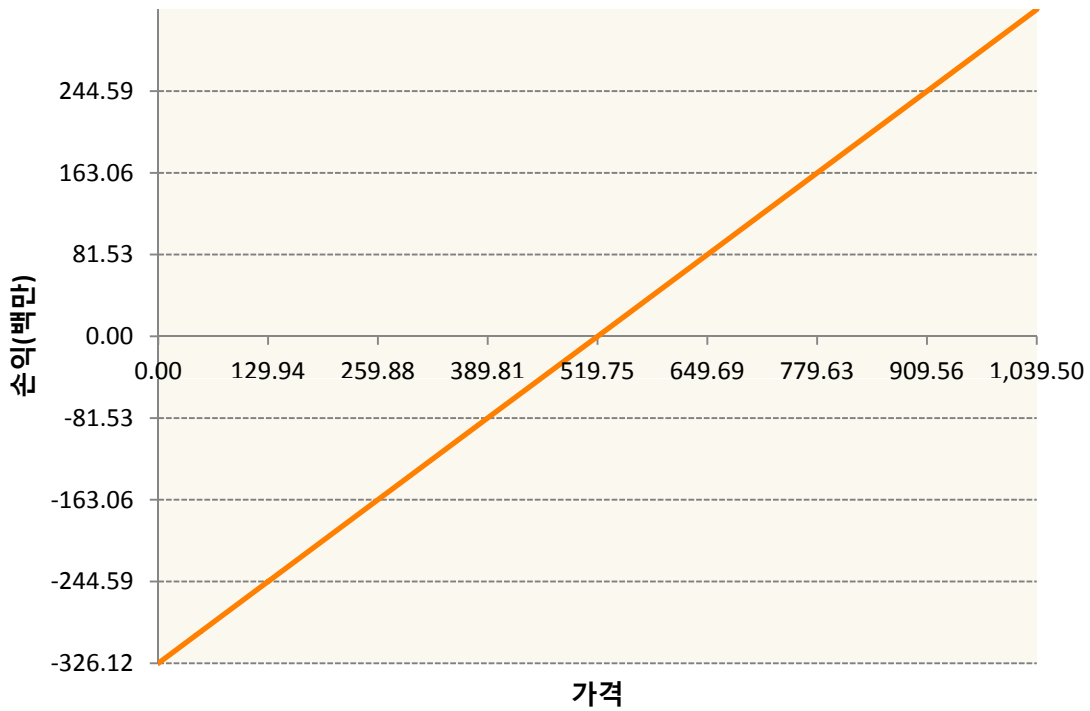


SN9-SOYBEAN FUTURE Jul19





WN9-WHEAT FUTURE(CBT) Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BON9	SOYBEAN OIL FUTR Jul19	24
CN9	CORN FUTURE Jul19	56
CTN9	COTTON NO.2 FUTR Jul19	13
KCN9	COFFEE 'C' FUTURE Jul19	21
KR4175P600	2019-06 달러선물	16

KWN9	KC HRW WHEAT FUT Jul19	9
SBN9	SUGAR #11 (WORLD) Jul19	25
SMN9	SOYBEAN MEAL FUTR Jul19	29
SN9	SOYBEAN FUTURE Jul19	48
WN9	WHEAT FUTURE(CBT) Jul19	26

**4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)**

(단위:백만원)

**267**